



信息披露 Disclosure

2011年8月29日 星期一 C97

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一一年八月二十九日

\$1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核后不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告告白自2011年6月01日起至06月30日止。

\$2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称：工银瑞信核心价值股票型证券投资基金

基金主代码：480100

交易代码：480100

契约型开放式

基金运作方式：开放式

基金合同生效日：2005年8月31日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：29,412,590,620.16份

基金合同存续期：不长期

2.2 基金产品说明

投资目标：有效控制投资组合风险，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略：股票价格终将反映其真实价值。本基金投资于经营稳健，具有核心竞争优势的企业，在价值被低估的大中型上市公司，实现基金资产长期稳定的增值目标。

业绩比较基准：75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率

本基金属于股票型基金中的大盘价值型基金，一般情况下，其风险及预期收益高于货币市场基金、债券基金及混合型基金。

风险收益特征：本基金为股票型基金，风险较高，预期收益较高。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

名称：工银瑞信基金管理有限公司

姓名：朱艳华

联系电话：010-58698918

电子邮箱：customerservice@icbccs.com.cn

客户服务电话：010-58698918

传真：010-66583158

010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址：www.icbccs.com.cn

基金半年度报告置地：基金管理人和基金托管人的住所

3 \$3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标

报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)

本期已实现收益：118,549,277.45

本期利润：-616,934,190.08

加权平均基金份额本期利润：-0.0236

本期基金份额净值增长率为-6.64%

3.1.2期末数据和指标

报告期末(2011年6月30日)

期末可供分配基金份额利润：0.0119

期末基金资产净值：9,927,086,253.53

期末基金份额净值：0.3375

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平低于所列示数据；

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3.本基金基金合同生效日为2005年8月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

阶段

份额净值增

份额净值增

业绩比较基

准收益率(%)

业绩比较基

准收益率差

(①-③)

(②-④)

①-③

②-④

过去一个月：2.06% 1.19% 1.00% 0.91% 1.06% 0.28%

过去二个月：-5.44% 1.09% -4.10% 0.82% -1.34% 0.27%

过去三个月：-6.64% 1.21% -2.19% 0.92% -4.45% 0.29%

过去一年：20.09% 1.35% 13.92% 1.04% 6.17% 0.31%

过去三年：31.60% 1.45% 13.49% 1.50% 18.11% -0.05%

自基金合同生效日起至今：352.22% 1.57% 178.95% 1.53% 173.27% 0.04%

注：1.本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率，每日进行再平衡计算。

2.本基金的基金合同生效日为2005年8月31日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3基金净值表现

3.2.4基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

阶段

份额净值增

长率(%)

业绩比较基

准收益率(%)

业绩比较基

准收益率差

(①-③)

(②-④)

①-③

②-④

过去一个月：2.06% 1.19% 1.00% 0.91% 1.06% 0.28%

过去二个月：-5.44% 1.09% -4.10% 0.82% -1.34% 0.27%

过去三个月：-6.64% 1.21% -2.19% 0.92% -4.45% 0.29%

过去一年：20.09% 1.35% 13.92% 1.04% 6.17% 0.31%

过去三年：31.60% 1.45% 13.49% 1.50% 18.11% -0.05%

自基金合同生效日起至今：352.22% 1.57% 178.95% 1.53% 173.27% 0.04%

注：1.本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率，每日进行再平衡。

2.本基金的基金合同生效日为2005年8月31日。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3基金净值表现

3.2.4基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

阶段

份额净值增

长率(%)

业绩比较基

准收益率(%)

业绩比较基

准收益率差

(①-③)

(②-④)

①-③

②-④

过去一个月：2.06% 1.19% 1.00% 0.91% 1.06% 0.28%

过去二个月：-5.44% 1.09% -4.10% 0.82% -1.34% 0.27%

过去三个月：-6.64% 1.21% -2.19% 0.92% -4.45% 0.29%

过去一年：20.09% 1.35% 13.92% 1.04% 6.17% 0.31%

过去三年：31.60% 1.45% 13.49% 1.50% 18.11% -0.05%

自基金合同生效日起至今：352.22% 1.57% 178.95% 1.53% 173.27% 0.04%

注：1.本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率，每日进行再平衡。

2.本基金的基金合同生效日为2005年8月31日。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3基金净值表现

3.2.4基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

阶段

份额净值增

长率(%)

业绩比较基

准收益率(%)

业绩比较基

准收益率差

(①-③)

(②-④)

①-③

②-④

过去一个月：2.06% 1.19% 1.00% 0.91% 1.06% 0.28%

过去二个月：-5.44% 1.09% -4.10% 0.82% -1.34% 0.27%

过去三个月：-6.64% 1.21% -2.19% 0.92% -4.45% 0.29%

过去一年：20.09% 1.35% 13.92% 1.04% 6.17% 0.31%

过去三年：31.60% 1.45% 13.49% 1.50% 18.11% -0.05%

自基金合同生效日起至今：352.22% 1.57% 178.95% 1.53% 173.27% 0.04%

注：1.本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率，每日进行再平衡。

2.本基金的基金合同生效日为2005年8月31日。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3基金净值表现

3.2.4基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

阶段

份额净值增