

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

我们将继续维持较高的信用债仓位和保持中行转债较高配置。我们仍将继续关注新股申购和增发的机会。

我们将继续维持较高的信用债仓位和保持中行转债较高配置。我们仍将继续关注新股申购和增发的机会。

3	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其中：买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	66,003,463.80	1.28
6	其他资产	69,718,922.66	1.35
7	合计	5,173,671,869.32	100.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药生物	-	-
C	制造业	220,158,314.64	7.25
D	食品饮料	-	-
E	纺织服装、皮毛	-	-
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	-	-
H	石油、化学、塑胶、塑料	48,209,250.36	1.59
I	电子	-	-
J	金属、非金属	25,454,255.80	0.84

C7	机械、设备、仪表	68,121,342.58	2.24
C8	医药、生物制品	74,085,000.00	2.46
C9	其他制造业	3,488,500.00	0.12
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,930,057.60	0.13
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	—	—
H	批发和零售业	—	—
I	金融、保险业	83,434,002.85	2.76
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	307,722,374.79	10.14

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占净资产公允价值比例 (%)
1	601901	方正证券	12,847,005	83,634,002.55	2.76
2	002603	以岭药业	1,950,000	74,685,000.00	2.46
3	002601	佰利联	400,000	32,980,000.00	1.09
4	300259	新天科技	950,000	19,190,000.00	0.63
5	300257	开山股份	300,000	19,173,000.00	0.63

6	020602	世纪华通	1,009,000	18,350,500.00	0.60
7	601636	际华集团	1,422,580	13,528,735.80	0.45
8	002596	海康电子	850,000	11,925,500.00	0.39
9	800225	金一软件	439,000	10,225,400.00	0.34
10	601022	航发电子	499,558	6,438,407.58	0.21

5.4 报告期末按投资品种分类的证券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	79,061,600.00	2.60
2	央行票据	—	—
3	金融债券	973,772,000.00	32.08
4	其中:政策性金融债	973,772,000.00	32.08
4	企业债券	2,772,704,305.75	91.34
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	其他	904,689,002.70	29.80
9	合计	4,780,228,908.75	155.83

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例之和可能与实际略有误差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中债转债	9,942,730	904,689,002.70	29.80
2	000716	国电晋16	4,500,000	457,470,000.00	15.15
3	090214	国电晋14	3,400,000	356,909,000.00	11.76
4	126018	0811国航	3,171,840	250,575,360.00	8.25

5	112006	(8万科G2)	2,096,420	211,319,136.00	6.96
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细					
本基金本报告期末未持有资产支持证券。					
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细					
本基金本报告期末未持有权证。					

5.8 投资组合报告摘要						
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。						
5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。						
5.8.3 其他资产构成						
	序号	名称	金额(元)			
1	1	存出保证金	231,578.75			
2	2	应收证券清算款	-			
3	3	应收股利	-			
4	4	应收利息	-			
5	5	应收申购款	69,266,818.97			
6	6	其他应收款	230,524.96			
7	7	持有待售资产	-			
8	8	其他	-			
9	9	合计	69,718,922.68			
5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细						
	序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	1	113001	中开转债	904,489,002.70	29.80	
5.8.5 报告期末前十名股票中存在受限受限情况的说明						
	序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	1	601901	方正证券	83,634,002.55	2.76	新股锁定
2	2	002063	以岭药业	74,685,000.00	2.46	新股锁定
3	3	002061	佰利转	32,980,000.00	1.09	新股锁定
4	4	300259	同洲科技	19,190,000.00	0.63	新股锁定

6	002062	南方开元	18,350,000.00	0.60	新股锁定
7	601636	招商集团	13,528,735.80	0.45	新股锁定
8	002596	海南机场	11,925,500.00	0.39	新股锁定
9	603222	林洋电子	6,438,407.58	0.21	新股锁定

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§6 开放式基金份额变动

项目	工银上证科创板50 指数基金 A	工银上证科创板50 指数基金 B
本报告期期初基金份额总额	2,652,110,023.93	1,155,441,459.30
本报告期基金已申购的份额	46,323,136.40	40,166,287.76
减:本报告期基金已赎回的份额	473,973,936.63	248,212,921.47
本报告期基金净申购/赎回的份额	1,224,459,223.70	947,373,322.00
本报告期期末基金份额总额	3,876,489,223.70	1,602,824,781.30

元。

§7 影响投资决策的其他重要信息

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 中国证监会批准工银国际信用添利证券投资基金设立的投资基金的文件;
- 工银国际信用添利证券投资基金基金合同;
- 工银国际信用添利证券投资基金基金托管协议;
- 基金管理人、基金托管人营业执照;
- 基金管理人、基金托管人资质证书;
- 报告期内基金管理人及托管人履行职务的情况报告;
- 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.2 查阅方式

投资者可在业务时间免费查阅。也可在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复印件。

	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	56,867,289.98	5.22

7	其他资产	1,379,242.35	0.13
8	合计	1,090,448.945.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
 本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
 本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期内基金投资资产减值准备计提情况		
本基金本报告期末未持有资产减值准备		
5.5 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细		
本基金本报告期末未持有债券		
5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细		
本基金本报告期末未持有资产支持证券		
5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细		
报告期内本基金未持有权证		
5.8 投资组合报告附注		
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形		
5.8.2 本基金投资的前十名证券未超出基金合同约定的备选股票库。		
5.8.3 其他资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	764,391.43
2	应收证券清算款	498,434.86
3	应收股利	-
4	应收利息	11,842.28
5	应收申购款	104,574.28
6	其他应收款	-
7	预摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,379,242.35
5.8.4 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细		
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券		
5.8.5 报告期内前十名股票中持有流通受限的股票说明		
本基金本报告期末未存在流通受限的股票投资		
5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分		
无。		

期末, 本期利息基金总额(万元)	50,916,580.86
本期利息基金约分变动(万元)	-
本期到期期末基金总额(万元)	1,350,373,915.49

光。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金设立的文件;
2. 在《深圳证证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》;
3. 在《深圳证证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;
4. 基金管理人业务资格和营业执照;
5. 基金托管人业务资格和营业执照;
6. 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
7. 基金份额持有人名册;
8. 基金管理人或基金托管人。

8.2 查阅方式

投资者可在基金管理人或基金托管人处, 也可在支付卡下, 可查询和打印上述文件或复印件。

[J&S\(Ph\) - J&S\(Ph\)\(Ph\)⁺\(Ph₂PPhO\)](#) [J&S\(Ar\)-J&S\(Ar\)\(Ar\)⁺\(Ar₂PPhO\)](#)