

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
基金名称:工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金

重要提示: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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

2.1 基金基本情况
基金名称:工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金
基金代码:480107
基金简称:工银基本面量化策略

2.2 基金投资目标
本基金为股票型基金,主要投资于具有良好成长性的股票,追求基金资产的长期增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

3.1 主要会计数据和财务指标
报告期:2012年6月30日
本期已实现收益:4,808,791.72
本期利润:-31,261,264.54

3.2 期末资产和负债
期末资产:1,276,929,841.27
期末负债:1,276,929,841.27

3.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的对比
基金名称:工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金
业绩比较基准:80%沪深300指数收益率+20%上证国债指数收益率

基金业绩比较基准:80%沪深300指数收益率+20%上证国债指数收益率
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

基金管理人及基金托管人
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

工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金

2012 半年度报告摘要

2012年6月30日

基金资产的估值:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.1 估值方法:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.2 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.3 估值对象:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.4 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.5 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.6 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.7 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.8 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.9 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.10 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.11 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.12 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.13 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.14 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.15 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.16 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.17 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.18 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.19 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.20 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.21 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.22 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.23 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.24 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.25 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.26 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.27 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.28 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.29 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.30 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.31 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

4.32 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。
4.33 估值程序:本基金按照公允价值进行估值,公允价值计量属性为公允价值。

注:由于四舍五入的原因,部分公允价值与基金份额净值合计项之和与合计项可能存在尾差。
7.3 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明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.4 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.2 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.2.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.3 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.3.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.4 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.4.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.5 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.5.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.6 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.6.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.7 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.7.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.8 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.8.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.9 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.9.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.10 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.10.1 期末按市值排名前十的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.11 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.11.1 期末按市值排名前十的股票明细

7.4.12 期末按市值排名前十的股票明细
7.4.12.1 期末按市值排名前十的股票明细