

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
报告送出日期:二〇一二年四月二十日

基金管理人及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责任。

基金管理人中国银行股份有限公司,于2012年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。投资有风险,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。

本报告期内财务资料未经审计。
本报告自2012年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码. Rows include 工银中证500指数, 工银沪深300指数, etc.

基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2012年1月31日

报告期末基金份额总额: 296,403,091.13份

投资目标: 运用指数化投资,通过跟踪标的指数实现对标的指数的跟踪,实现跟踪标的指数的投资目标。

投资策略: 本基金采取完全复制法,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重进行相应调整。

业绩比较基准: 中证500指数收益率*95%+商业银行人民币活期存款利率*5%

风险收益特征: 本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

主要财务指标: 1.本期已实现收益 583,851.99
2.本期利润 -2,694,061.56

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0080
4.期末基金资产净值 293,899,707.63

5.期末基金份额净值 1.0000

注:1.本基金基金合同于2012年1月31日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满后,本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条“投资范围、(七)投资禁止行为与限制中规定的各项本基金投资于股票资产占基金资产

净值比例不超过30%”的规定,且符合中国证监会规定的其他投资比例限制。

3.本基金资产组合中,本基金投资于股票资产占基金资产净值比例不超过30%。

4.本基金资产组合中,本基金投资于权证资产占基金资产净值比例不超过3%。

5.本基金资产组合中,本基金投资于股指期货资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

6.本基金资产组合中,本基金投资于国债期货资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

7.本基金资产组合中,本基金投资于商品期货资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

8.本基金资产组合中,本基金投资于期权资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

9.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

10.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

11.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

12.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

13.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

14.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

15.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

16.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

17.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

18.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

19.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

20.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

21.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

22.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

23.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

24.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

25.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

26.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

27.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

28.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

29.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

30.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

31.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

32.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

33.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

34.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

35.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

36.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

37.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

38.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

39.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

40.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

41.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

42.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

43.本基金资产组合中,本基金投资于其他衍生品资产占基金资产净值比例不超过基金资产净值的10%。

工银瑞信睿智中证500指数基金

2012 第一季度报告

净值的比例为90%-95%,其中标的指数成分股、备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%。现

在基金资产中,中国证监会核准上市交易的股票资产占基金资产净值比例不低于90%。其中现金

或到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产净值5%;权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规

和监管机构的规定;法律法规及基金合同规定的其他比例限制。

3.3 其他指标

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

何江 本基金基金经理 2012年1月31日 7 先后在北京万信信融科技有

限公司担任高级分析师,诚信信用评级有限公司担任分析

2005年加入工银瑞信,曾任风

险管理部投资风险管理业务

主管,2011年5月28日至今担

任工银沪深300基金、工银

央企ETF基金、工银深证红

利ETF基金、工银深证红利

ETF联接基金、工银深证红

利ETF联接基金基金经理。2012年1月31日至今担任工银中

证500基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等

有关基金法律法规的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,

为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行

为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公

司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理

办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和

市场价格差较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价

格优先的原则,本公司对满足限价条件且同一证券有相同交易需求的基金投资组合,均采用了系统

中的公平交易模块进行执行,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与基金管

理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞

价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的情况有一次,投资组合经理因投资

组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年一季度,股市场迎来了久违的反弹,前2个月上涨,3月份市场再次下跌调整,行业表现方面,大

部分行业表现较好,包括食品饮料、医药、国防军工、有色金属、国防军工、国防军工、国防军工等。一

些前期调整的行业,如钢铁、有色金属、国防军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整

的行业,如钢铁、有色金属、国防军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整的行业,如

钢铁、有色金属、国防军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整的行业,如钢铁、有色

金属、国防军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整的行业,如钢铁、有色金属、国防

军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整的行业,如钢铁、有色金属、国防军工、国

防军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整的行业,如钢铁、有色金属、国防军工、

国防军工、国防军工、国防军工、国防军工等。一些前期调整的行业,如钢铁、有色金属、国防军工、

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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五名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金报告期内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规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.12 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.13 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.15 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.18 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.19 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.20 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.21 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.23 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.24 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.25 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.26 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.27 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.28 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.29 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.30 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.31 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.32 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.33 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.35 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.36 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.37 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.38 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.39 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.40 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.41 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.42 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.43 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.44 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.45 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.46 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.47 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.48 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.49 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.50 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.51 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.52 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.53 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.54 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
报告送出日期:二〇一二年四月二十日

基金管理人及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责任。

基金管理人中国银行股份有限公司,于2012年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。投资有风险,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。

本报告期内财务资料未经审计。
本报告自2012年1月1日起至3月31日止。

基金名称: 工银大盘蓝筹股票
基金代码: 481008

基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2008年8月4日

报告期末基金份额总额: 594,227,883.33份

投资目标: 本基金主要投资于大盘蓝筹股票,追求基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的超额收益。

投资策略: 本基金主要投资于大盘蓝筹股票,追求基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的超额收益。

业绩比较基准: 沪深300指数收益率*20%+上证国债指数收益率*80%

风险收益特征: 本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

主要财务指标: 1.本期已实现收益 -29,840,936.79
2.本期利润 16,221,968.38

3.加权平均基金份额本期利润 0.0241
4.期末基金资产净值 468,041,002.11

5.期末基金份额净值 0.788

注:1.本基金基金合同于2008年8月4日生效,按基金合同约定,本基金自基金合同生效起6个月内为建

仓期,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第十四条“C.投资范围、(八)投资限制中规定的

各项比例;本基金投资于股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为

5%-40%,基金持有的到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产净值的5%。本基金持有的全部权证,其

公允价值不超过基金资产净值的3%;法律法规及基金合同规定的其他比例限制。

3.3 其他指标

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

胡永刚 本基金基金经理 2011年3月16日 11 曾任在平安证券股份有限公

司担任研究员,2009年加入工银瑞信基金管

理,2011年3月16日至今担任

工银大盘蓝筹股票基金

基金经理。2011年3月16日至今担任

工银大盘蓝筹股票基金

工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金

2012 第一季度报告

市值不得超过基金资产净值的3%;法律法规及基金合同规定的其他比例限制。

3.3 其他指标

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

胡永刚 本基金基金经理 2011年3月16日 11 曾任在平安证券股份有限公