

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

2012】第二季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7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內容，保证复核后的内容不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称:工银瑞利债券

交易代码:485101

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年1月14日

基金总资产的份额总额:3,127,308,742.44份

投资目标:在控制风险与保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金将采取积极的信用策略，利用策略，相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘市场中被严重低估的投资机会，实现稳健增值。

业绩比较基准:80%×债券基金指数+20%×国债指数

风险特征:本基金为债券型基金，属于低风险基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，风险低于股票型基金。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称:工银瑞利债券A 工银瑞利债券B

下属分级基金的交易代码:485101 485007

报告期末基金份额的份额总额:1,775,011,647.66份

1,352,297,094.78份

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

报告期(2012年4月1日—2012年6月30日)

1. 权益投资

其中:股票 361,274,673.51 5.70

2. 固定收益投资

其中:债券 5,446,484,486.89 85.94

其中:资产支持证券 - 85.94

3. 贵金属及珠宝 - -

4. 其他金融资产 - -

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 130,114,860.63 2.05

6. 其他资产 399,643,788.63 6.31

7. 合计 367,517,809.66 100.00

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项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

单位:人民币元

报告期(2012年4月1日—2012年6月30日)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 制造业 7,202,367.00 0.21

C 制造业 128,621,826.00 3.78

D 食品、饮料 - -

E 纺织、服装、皮毛 - -

F 电子、电器、仪器 - -

G 石油、化学、塑胶、塑料 18,379,826.00 0.54

H 电子 55,096,000.00 1.62

I 金属、非金属 - -

J 机械设备、仪表 55,146,000.00 1.62

K 生物制品 - -

L 采矿业 - -

M 电力、煤气及水的生产和供应业 67,340,000.00 1.98

N 建筑业 - -

O 交通运输、仓储业 - -

P 银行业 37,133,844.00 1.09

Q 批发和零售业 100,800,000.00 2.97

R 房地产业 - -

S 科学、技术服务和地质勘查业 10,117,270.38 0.30

T 传播与文化产业 - -

U 综合类 10,059,366.13 0.30

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2012年4月1日—2012年6月30日)

1.本期末实现收益 -1,293,183.63 40,812.41

2.本期利润 124,187,992.27 62,439,745.20

3.加权平均基金份额本期利润 0.0704 0.0596

4.期末基金资产净值 1,944,867,724.67 1,453,720,249.92

5.期末基金份额总额 1,0957 1,0750

注:上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要低于相应的业绩指标。

6.期末可供分配基金份额利润 -0.0056

7.期末可供分配金额 10,059,366.13

8.期末可供分配基金份额总额 10,059,366.13

9.期末可供分配比例 0.0001

10.期末可供分配基金份额总额与期末基金资产净值的差额 -0.0001

11.报告期净资产收益率 -0.0056%

12.报告期加权平均净值收益率 -0.0056%

13.报告期净值收益率偏离度 -0.0001%

14.报告期净值收益率标准差 0.0001

15.报告期夏普比率 0.0001

16.报告期特雷诺比率 0.0001

17.报告期信息比率 0.0001

18.报告期跟踪误差 0.0001

19.报告期跟踪误差标准差 0.0001

20.报告期下行偏斜度 0.0001

21.报告期上行偏斜度 0.0001

22.报告期夏普比率标准差 0.0001

23.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

24.报告期信息比率标准差 0.0001

25.报告期跟踪误差标准差 0.0001

26.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

27.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

28.报告期夏普比率标准差 0.0001

29.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

30.报告期信息比率标准差 0.0001

31.报告期跟踪误差标准差 0.0001

32.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

33.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

34.报告期夏普比率标准差 0.0001

35.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

36.报告期信息比率标准差 0.0001

37.报告期跟踪误差标准差 0.0001

38.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

39.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

40.报告期夏普比率标准差 0.0001

41.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

42.报告期信息比率标准差 0.0001

43.报告期跟踪误差标准差 0.0001

44.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

45.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

46.报告期夏普比率标准差 0.0001

47.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

48.报告期信息比率标准差 0.0001

49.报告期跟踪误差标准差 0.0001

50.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

51.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

52.报告期夏普比率标准差 0.0001

53.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

54.报告期信息比率标准差 0.0001

55.报告期跟踪误差标准差 0.0001

56.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

57.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

58.报告期夏普比率标准差 0.0001

59.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

60.报告期信息比率标准差 0.0001

61.报告期跟踪误差标准差 0.0001

62.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

63.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

64.报告期夏普比率标准差 0.0001

65.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

66.报告期信息比率标准差 0.0001

67.报告期跟踪误差标准差 0.0001

68.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

69.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

70.报告期夏普比率标准差 0.0001

71.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

72.报告期信息比率标准差 0.0001

73.报告期跟踪误差标准差 0.0001

74.报告期下行偏斜度标准差 0.0001

75.报告期上行偏斜度标准差 0.0001

76.报告期夏普比率标准差 0.0001

77.报告期特雷诺比率标准差 0.0001

78.报告期信息比率标准差 0.0001

79.报告期跟踪误差标准差 0.0001

80.报告期下行偏斜度标准差 0.0001