

工银瑞信核心价值股票型证券投资基金

[2013] 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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§ 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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，于2013年7月12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。
本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		工银瑞信核心价值股票
交易代码		481001
基金运作方式		契约型开放式
基金合同生效日		2005年8月11日
报告期末基金份额总额		24,882,581,273.09份

投资目标 本基金将长期投资于价值低估、追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 投资风格将追求其价值。本基金投资于经营稳健、具有核心竞争优势、价值低估的大型上市公司，实现基金资产长期稳健增值的目标。

业绩比较基准 $75\% \times \text{中信标普300指数收益率} + 25\% \times \text{中信标普全债指数收益率}$

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

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中银银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益 99,958,793.29

2.本期利润 -96,935,026.24

3.期初平均基金份额本期利润 -0.0036

4.期末基金份额净值 6,835,503,263.64

5.期末基金份额净值 0.2747

注:1.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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.期末可供分配利润指基金本期利息收入、投资收益、其他收入, 不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1 报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 其他指标

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明

何江旭 权益投资总监,本基金的基金经理。 2010年4月12日 - 16 曾担任国泰基金鑫鑫基金、基金助理,基金稳健回报、基金增长等以股票投资为主要内容的基金经理,基金投资部总监兼权益投资副总监,2009年加入工银瑞信,现任权益投资总监,2010年4月12日至今,担任工银核心价值股票基金经理,基金行业研究员,基金经理的基金经理。

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,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文件的规定, 诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产, 在控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋取最大利益, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度执行的专项说明

4.4 报告期内基金投资组合运作分析

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.6 报告期内基金的业绩表现

4.7 报告期内基金的业绩表现

4.8 报告期内基金的业绩表现

4.9 报告期内基金的业绩表现

4.10 报告期内基金的业绩表现

4.11 报告期内基金的业绩表现

4.12 报告期内基金的业绩表现

4.13 报告期内基金的业绩表现

4.14 报告期内基金的业绩表现

4.15 报告期内基金的业绩表现

4.16 报告期内基金的业绩表现

4.17 报告期内基金的业绩表现

4.18 报告期内基金的业绩表现

4.19 报告期内基金的业绩表现

4.20 报告期内基金的业绩表现

4.21 报告期内基金的业绩表现

4.22 报告期内基金的业绩表现

4.23 报告期内基金的业绩表现

4.24 报告期内基金的业绩表现

4.25 报告期内基金的业绩表现

4.26 报告期内基金的业绩表现

4.27 报告期内基金的业绩表现

4.28 报告期内基金的业绩表现

4.29 报告期内基金的业绩表现

4.30 报告期内基金的业绩表现

4.31 报告期内基金的业绩表现

4.32 报告期内基金的业绩表现

4.33 报告期内基金的业绩表现

4.34 报告期内基金的业绩表现

4.35 报告期内基金的业绩表现

4.36 报告期内基金的业绩表现

4.37 报告期内基金的业绩表现

4.38 报告期内基金的业绩表现

4.39 报告期内基金的业绩表现

4.40 报告期内基金的业绩表现

4.41 报告期内基金的业绩表现

4.42 报告期内基金的业绩表现

4.43 报告期内基金的业绩表现

4.44 报告期内基金的业绩表现

4.45 报告期内基金的业绩表现

4.46 报告期内基金的业绩表现

4.47 报告期内基金的业绩表现

4.48 报告期内基金的业绩表现

4.49 报告期内基金的业绩表现

4.50 报告期内基金的业绩表现

4.51 报告期内基金的业绩表现

4.52 报告期内基金的业绩表现

4.53 报告期内基金的业绩表现

4.54 报告期内基金的业绩表现

4.55 报告期内基金的业绩表现

4.56 报告期内基金的业绩表现

4.57 报告期内基金的业绩表现

4.58 报告期内基金的业绩表现

4.59 报告期内基金的业绩表现

4.60 报告期内基金的业绩表现

4.61 报告期内基金的业绩表现

4.62 报告期内基金的业绩表现

4.63 报告期内基金的业绩表现

4.64 报告期内基金的业绩表现

4.65 报告期内基金的业绩表现

4.66 报告期内基金的业绩表现

4.67 报告期内基金的业绩表现

4.68 报告期内基金的业绩表现

4.69 报告期内基金的业绩表现

4.70 报告期内基金的业绩表现

4.71 报告期内基金的业绩表现

4.72 报告期内基金的业绩表现

4.73 报告期内基金的业绩表现

4.74 报告期内基金的业绩表现

4.75 报告期内基金的业绩表现

4.76 报告期内基金的业绩表现

4.77 报告期内基金的业绩表现

4.78 报告期内基金的业绩表现

4.79 报告期内基金的业绩表现

4.80 报告期内基金的业绩表现

4.81 报告期内基金的业绩表现

4.82 报告期内基金的业绩表现

4.83 报告期内基金的业绩表现

4.84 报告期内基金的业绩表现

4.85 报告期内基金的业绩表现

4.86 报告期内基金的业绩表现

4.87 报告期内基金的业绩表现

4.88 报告期内基金的业绩表现

4.89 报告期内基金的业绩表现

4.90 报告期内基金的业绩表现

4.91 报告期内基金的业绩表现

4.92 报告期内基金的业绩表现

4.93 报告期内基金的业绩表现

4.94 报告期内基金的业绩表现

4.95 报告期内基金的业绩表现

4.96 报告期内基金的业绩表现

4.97 报告期内基金的业绩表现

4.98 报告期内基金的业绩表现

4.99 报告期内基金的业绩表现

4.10 报告期内基金的业绩表现

4.11 报告期内基金的业绩表现

4.12 报告期内基金的业绩表现

4.13 报告期内基金的业绩表现

4.14 报告期内基金的业绩表现

4.15 报告期内基金的业绩表现

4.16 报告期内基金的业绩表现

4.17 报告期内基金的业绩表现

4.18 报告期内基金的业绩表现

4.19 报告期内基金的业绩表现

4.20 报告期内基金的业绩表现

4.21 报告期内基金的业绩表现

4.22 报告期内基金的业绩表现

4.23 报告期内基金的业绩表现

4.24 报告期内基金的业绩表现

4.25 报告期内基金的业绩表现

4.26 报告期内基金的业绩表现

4.27 报告期内基金的业绩表现

4.28 报告期内基金的业绩表现

4.29 报告期内基金的业绩表现

4.30 报告期内基金的业绩表现

4.31 报告期内基金的业绩表现

4.32 报告期内基金的业绩表现

4.33 报告期内基金的业绩表现

4.34 报告期内基金的业绩表现

4.35 报告期内基金的业绩表现

4.36 报告期内基金的业绩表现

4.37 报告期内基金的业绩表现

4.38 报告期内基金的业绩表现

4.39 报告期内基金的业绩表现

4.40 报告期内基金的业绩表现