

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
送出日期:二〇一五年八月二十六日

§ 1.重要提示
基金管理人的董事会、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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签署
报告书。基金管理人和托管人根据本基金合同规定，于2015年8月21日复核了本报告中的
财务指标、净值表现、利率分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证核对内容不存在虚假记
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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
招募说明书及其摘要载入本公司网站。投资者在申购基金前应仔细阅读本基金的
招募说明书及其摘要。
本报告期未发生损害投资者利益的重大事件。
本报告期财务数据未经审计。
本报告期自2015年01月01日起至2015年06月30日止。

§ 2.基金简介

2.1 基金基本情况	工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
基金合同生效日	2013年2月7日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
基金合同存续期间	7,651,594,586.79
基金合同终止日	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 通过运用定比例组合保险策略，控制本金损失的

风险，并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳健增值。

投资策略 本基金在资产配置策略上，采用恒定比例投资组合保险策略

（Constant Proportion Portfolio Insurance, CPI）来实现保本和

增值的双重目标。

风险收益特征 本基金为保本混合型基金，属于基金中的低风险品

种。

基金管理人和基金托管人

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

基金名称:工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金

报告期截至日:2015年6月30日

单位:人民币元

§ 3.主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1.1 利润和收入

报告期:2015年1月1日—2015年6月30日

3.1.1.1 利润和收入

报告期利润 378,028,780.04

本期利润 337,910,796.10

加权平均基金份额本期利润 0.1167

本期基金份额净值增长率 17.27%

3.1.2 利润和收入

报告期:2015年6月30日

3.1.2.1 利润和收入

利润总额 5,038.00

未分配利润 10,593,886,611.68

期末基金资产净值 1,389.00

注:1.所述基金业报酬率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.本期已实现收益是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, 本报告期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3.基金净值增长率=基金净值增长率/基金净值增长日为2013年2月7日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段 份额增长倍数 份额净值增长率 业绩比较基准收益率 ①-③ ②-④

过去一个月 0.22% 0.16% 0.01% -0.13% 0.16%

过去三个月 0.35% 0.15% 1.00% 0.01% 25.69% 0.14%

过去六个月 17.22% 0.26% 1.98% 0.01% 15.20% 0.24%

过去一年 32.28% 0.24% 4.13% 0.01% 28.15% 0.23%

自基金合同生效日起至今 38.04% 0.16% 10.86% 0.01% 28.45% 0.16%

注:1.本基金基金合同期于2013年2月7日生效。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司, 成立于2005年6月21日, 是我国第一家由银行直接发

起设立并控股的全国性基金管理公司。工银瑞信在公司目前共同经营的基金、企业年金、投资管理、保险资金

和养老金管理、境外投资、养老金管理、企业年金、年金基金、投资管理业务

。截至2015年6月30日, 公司旗下管理6只公募基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工

银瑞信价值精选股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工

银瑞信货币基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信

货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信

货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信货币基金、工银瑞信