

# 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2007 年半年度报告

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

送出日期：二 00 七年八月二十七日

## 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2007 年 8 月 7 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止，本报告财务资料未经审计。

## 目 录

一、基金简介.....	2
二、主要财务指标和基金净值表现.....	3
(一)主要会计数据和财务指标.....	3
(二)基金净值表现.....	3
三、管理人报告.....	5
(一)基金管理人及基金经理情况.....	5
(二)对报告期内基金运作的合规守信情况的说明.....	6
(三)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释.....	6
(四)对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望.....	6
四、托管人报告.....	7
五、财务会计报告.....	8
(一)基金会计报表.....	8
(二)半年度会计报表附注.....	10
六、投资组合报告.....	17
七、基金份额持有人情况.....	22
八、开放式基金份额变动情况.....	23
九、重大事件揭示.....	23
十、备查文件.....	27

## 一、 基金简介

### (一) 基金基本资料

1、基金名称:	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金
2、基金简称:	工银瑞信精选平衡
3、基金交易代码:	483003
4、基金运作方式:	契约型开放式
5、基金合同生效日:	2006年7月13日
6、报告期末基金份额总额:	11,311,408,011.71份
7、基金合同存续期:	不定期
8、基金份额上市的证券交易所:	无
9、上市日期:	无

### (二) 基金产品说明

1、投资目标:	有效控制投资组合风险,追求稳定收益与长期资本增值。
2、投资策略:	本基金专注基本面研究,遵循系统化、程序化的投资流程以保证投资决策的科学性与一致性。
3、业绩比较基准:	60%×沪深300指数收益率+40%×新华雷曼中国综合债券指数收益率。
4、风险收益特征:	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险水平基金。

### (三) 基金管理人

1、名称:	工银瑞信基金管理有限公司
2、注册地址:	北京市东城区朝内大街188号鸿安大厦
3、办公地址:	北京市东城区朝内大街188号鸿安大厦
4、邮政编码:	100010
5、法定代表人:	杨凯生
6、信息披露负责人:	夏洪彬
7、联系电话:	010-65179888
8、传真:	010-85159267
9、电子邮箱:	customerservice@icbccs.com.cn

### (四) 基金托管人

1、名称:	中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
2、注册地址:	北京市西城区金融大街25号
3、办公地址:	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
4、邮政编码:	100032
5、法定代表人:	郭树清
6、信息披露负责人:	尹东
7、联系电话:	010-67595104
8、传真:	010-66275853
9、电子邮箱:	Yindong@ccb.cn

### (五) 信息披露

信息披露报纸名称:	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载年度报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.icbccs.com.cn">http://www.icbccs.com.cn</a>

址:

基金年度报告置备地点: 基金管理人和基金托管人的办公场所

(六) 其他有关资料

1、基金注册登记机构名称: 工银瑞信基金管理有限公司

2、办公地址: 北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安大厦

## 二、 主要财务指标和基金净值表现

下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。

### (一) 主要会计数据和财务指标

序号	项目	2007 年 1 月 1 日到 2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	2,511,743,009.24 元
2	基金份额本期净收益	0.4566 元
3	期末可供分配基金收益	2,438,104,215.53 元
4	期末可供分配基金份额收益	0.2155 元
5	期末基金资产净值	11,140,085,938.52 元
6	期末基金份额净值	0.9849 元
7	基金加权平均净值收益率	34.90%
8	本期基金份额净值增长率	52.11%
9	基金份额累计净值增长率	102.51%

### (二) 基金净值表现

#### 1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

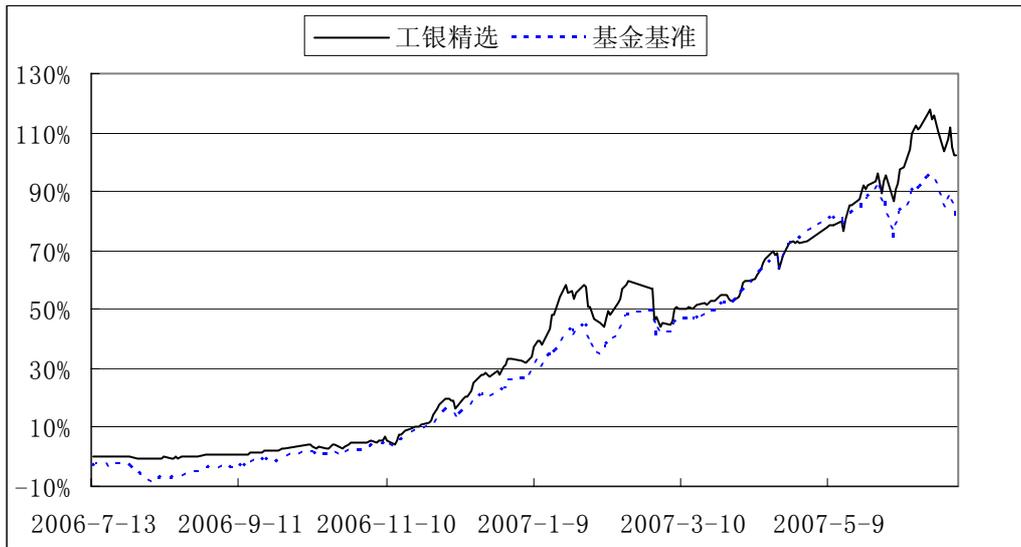
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.72%	2.12%	-2.68%	1.83%	7.40%	0.29%
过去三个月	32.54%	1.67%	19.58%	1.52%	12.96%	0.15%
过去六个月	52.11%	1.73%	44.71%	1.51%	7.40%	0.22%
自基金合同生 效日起至今	102.51%	1.33%	81.73%	1.23%	20.78%	0.10%

#### 2、本基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金累计份额净值增长率

与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年7月13日至2007年6月30日)



注：1、本基金合同于2006年7月13日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同规定，本基金投资组合的比例范围为：投资于股票资产的比例范围为40% - 80%，投资于债券及其它短期金融工具的比例为20% - 60%。按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在本报告期末，本基金的投资组合比例达到基金合同的要求。

3、2007年1月5日，公司决定增聘王筱苓女士为工银瑞信精选平衡混合型基金经理。

4、2007年3月21日，公司决定增聘杨建勋先生为工银瑞信精选平衡混合型基金经理。

### 三、 管理人报告

#### (一) 基金管理人及基金经理情况

##### 1. 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司。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合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币，注册地在北京。本基金管理人实行“投资决策委员会领导下的团队制”的投资管理模式，投资团队由资深的基金经理与研究员组成，具有丰富的基金投资管理经验。

截至2007年6月30日，本基金管理人旗下管理着5只开放式基金，分别是工银瑞信核心价值股票型基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型基金、工银瑞信稳健成长股票型基金、工银瑞信增强收益债券型基金，公司管理的资产规模约340亿元。

##### 2. 基金经理小组简介

吴刚先生：1994年毕业于南开大学，获理学硕士学位。2002年4月至2003年5月任职于中融基金管理公司，担任基金融鑫基金经理，2003年8月至2006年1月，任职于长盛基金管理公司，历任长盛成长价值、长盛动态精选基金经理。

杨建勋先生，2000年毕业于北京大学，获经济学硕士学位。1993年7月至1997年7月，任职于沈阳财政局会计师事务所。2000年7月至2006年9月，任职于鹏华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、普润基金经理、鹏华行业成长基金经理。

张翎先生：1999年毕业于英国利物浦大学，获工商管理硕士学位。先后在陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司、中国平安保险公司投资管理中心等公司从事投资管理工作。2002年起任职于泰信基金管理有限公司，2004年3月至2006年5月历任泰信天天收益基金经理，泰信先行策略基金经理。

王筱苓女士，1997年毕业于清华大学，获工商管理硕士学位。1997年7月任职于中国银行总行全球金融市场部，从事对外筹资业务。1998年12月至2002年12月，任职于中国银行全球金融市场部，从事外汇、衍生产品交易，担任客户业务处副处长。2002年12月至2005年6月任职于中国银行全球金融市场部，担任首席交易员，负责管理信用产品投资组合，结构性产品投资组合，以及客户资金投资管理。

## **(二) 对报告期内基金运作的合规守信情况的说明**

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责的为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他法律法规、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金合同》的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## **(三) 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释**

2007 年上半年, 经济走势强劲, 固定资产投资持续保持高位。出口增速仍然维持高位, 高额的贸易顺差持续, 国际收支严重失衡的局面短期内难以改变, 人民币汇率稳中有升。通货膨胀超过去年底绝大部分投资者的预期, 对经济增长形成一定的负面影响。

上半年股市大幅上涨, 沪深 300 指数涨幅为 84%。一季度, 垃圾股、资产重组等题材类型的股票受到追捧, 成交量剧增, 二季度指数大幅震荡, 沪深 300 指数震幅达 900 点, 幅度超过 20% , 低价、资产重组等题材类型的股票在市场震荡中大幅下跌, 而绩优股重新受到市场的追捧。

本基金坚持价值投资理念, 选择金融、医药、经常消费等行业中具有长期核心竞争力的优势公司进行长期投资。

截止报告期末, 本基金份额累计净值为 2.0037 元。本报告期份额净值增长率为 52.11%, 同期业绩比较基准增长率为 44.71%, 超过比较基准 7.4 个百分点。

## **(四) 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望**

下半年预期宏观经济仍然增长较快, 但有迹象表明中国经济面临一定的过热压力, 通货膨胀持续走高, 政府可能会采取调控措施降温, 这值得投资者密切关注。

预期证券市场会进入一段时间的调整, 一方面, 前期涨幅较大, 市场整体估值较高, 一定程度上透支了未来的成长; 另外, 一万五千亿特别国债的发行, 市场的利率期限结构可能发生变化, 加大市场的不确定性; 下半年大型国企的回归增加了市场的供应。从结构上分析, 由于前期市场波动加大, 垃圾、低价股的跌幅较大, 对投资者打击较大, 绩优股因为估值及长期发展良好的优势, 会重新受到投资者的追捧, 经过这次的风险教育, 投资者可能会更多的考虑股票的确定性、安全性。经过调整后, 持续的经济增长依然会推动证券市场的上涨。

展望下半年, 我们继续坚持价值投资的理念, 仍然看好金融、医药、经常消费等行业, 并将继续持有这些行业中的领先企业。

作为基金管理人，我们注重“制度先行、程序至上、内控优先、规范运作”，以稳健的投资管理，为客户创造卓越的价值。

#### 四、 托管人报告

##### 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金合同》和《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金托管协议》，托管工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金（以下简称工银精选基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在工银精选基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司在工银精选基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由工银精选基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## 五、 财务会计报告

### (一) 基金会计报表

#### 1. 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金资产负债表 (人民币: 元)

资产	附注	2006-12-31	2007-06-30
银行存款	7 (1)	54,434,207.98	619,162,847.06
清算备付金		11,781,055.30	24,414,817.84
交易保证金		1,035,348.19	1,680,285.05
应收证券清算款		113,034,838.98	-
应收股利		-	-
应收利息	7 (2)	18,818,753.75	27,736,822.75
应收申购款		4,450,838.41	1,599,385,347.43
其他应收款		-	-
股票投资市值	7 (4)	6,801,635,025.12	7,526,949,305.33
其中: 股票投资成本	7 (4)	4,710,823,675.69	5,031,021,585.92
债券投资市值	7 (4)	1,783,715,948.14	1,902,392,657.34
其中: 债券投资成本	7 (4)	1,774,532,419.52	1,901,728,546.20
权证投资	7 (4)	-	7,273,168.74
其中: 权证投资成本	7 (4)	-	2,779,801.57
买入返售证券		-	-
待摊费用	7 (3)	203,910.48	102,793.02
待回购债券		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b><u>8,789,109,926.35</u></b>	<b><u>11,709,098,044.56</u></b>
<b>负债</b>			
应付证券清算款		-	221,915,494.25
应付赎回款		126,955,856.62	26,054,788.25
应付赎回费		478,465.29	98,193.54
应付管理人报酬		10,945,490.53	12,665,199.23
应付托管费		1,824,248.41	2,110,866.54
应付佣金	7 (5)	4,291,990.67	11,315,393.14
应付利息		-	48,328.76
应付收益		-	-
其他应付款	7 (6)	768,731.15	764,170.75
卖出回购证券款		-	294,000,000.00
待返售证券		-	-
短期借款		-	-
预提费用	7 (7)	84,500.00	39,671.58
其他负债		-	-
<b>负债合计</b>		<b><u>145,349,282.67</u></b>	<b><u>569,012,106.04</u></b>

## 持有人权益

实收基金	7 (8)	6,492,932,768.13	6,327,524,379.76
未实现利得	7 (9)	1,840,054,419.63	2,374,457,343.23
未分配收益		310,773,455.92	2,438,104,215.53
<b>持有人权益合计</b>		<u>8,643,760,643.68</u>	<u>11,140,085,938.52</u>
<b>负债及持有人权益总计</b>		<u>8,789,109,926.35</u>	<u>11,709,098,044.56</u>
<b>基金份额净值</b>		<u>1.3313</u>	<u>0.9849</u>

## 2. 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金经营业绩表及收益分配表

### (1) 经营业绩表 (人民币: 元)

		2007年1月1日 至2007年6月30日
<b>收入:</b>		2,577,527,458.86
股票差价收入	7 (10)	2,503,687,877.24
债券差价收入	7 (11)	13,397,521.20
权证差价收入	7 (12)	-
债券利息收入		19,230,843.74
存款利息收入		2,283,449.45
股利收入		30,763,401.76
买入返售证券收入		127,823.29
其他收入	7 (13)	8,036,542.18
<b>费用:</b>		65,784,449.62
基金管理人报酬		53,026,564.72
基金托管费		8,837,760.80
卖出回购证券支出		3,699,494.85
其他费用	7 (14)	220,629.25
其中: 信息披露费	7 (14)	101,117.46
审计费用	7 (14)	39,671.58
<b>基金净收益</b>		<u>2,511,743,009.24</u>
加: 未实现利得 (估值增值)	7 (9)	<u>401,090,319.67</u>
<b>基金经营业绩</b>		<u>2,912,833,328.91</u>

### (2) 收益分配表 (人民币: 元)

	2007年1月1日至2007年6月30日
<b>本期基金净收益</b>	2,511,743,009.24
加: 期初基金净收益	310,773,455.92
加: 本期损益平准金	<u>964,172,101.35</u>

其中：申购		1,864,860,347.67
赎回		-900,688,246.32
<b>可供分配基金净收益</b>		<u>3,786,688,566.51</u>
减：本期已分配基金净收益	7 (15)	1,348,584,350.98
<b>期末基金净收益</b>		<u>2,438,104,215.53</u>

### 3. 基金净值变动表 (人民币：元)

2007年1月1日至2007年6月30日

<b>期初基金净值</b>		8,643,760,643.68
<b>本期经营活动：</b>		
基金净收益		2,511,743,009.24
未实现利得		401,090,319.67
经营活动产生的基金净值变动数		<u>2,912,833,328.91</u>
<b>本期基金单位交易：</b>		
基金申购款		7,360,687,665.78
基金赎回款		-6,428,611,348.87
基金单位交易产生的基金净值变动数		<u>932,076,316.91</u>
<b>本期向持有人分配收益：</b>		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-1,348,584,350.98
<b>期末基金净值</b>		<u>11,140,085,938.52</u>

## (二) 半年度会计报表附注

### 1. 本基金的基本情况

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金（简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2006]104号《关于同意工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金募集的批复》文件批准，于2006年6月15日至2006年7月11日向全社会公开募集。经安永华明会计师事务所验资，本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集期间募集的有效份额为8,367,767,126.76份基金份额，利息结转的基金份额为2,147,355.47份基金份额，两项合计共8,369,914,482.23份基金份额。基金合同生效日为2006年7月13日，合同生效日基金份额为8,369,914,482.23份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金合同》、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、中

央银行票据、回购，以及法律法规规定或经中国证监会批准基金投资的其它金融工具。本基金投资组合资产配置范围为：股票资产占基金资产净值的比例为 40%-80%，债券及其它短期金融工具占基金资产净值的比例为 20%-60%。

工银瑞信基金管理有限公司已于 2007 年 5 月 24 日（拆分日）对工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金进行了基金份额拆分操作。拆分日经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核的本基金拆分前基金份额净值为 1.7877 元。本基金管理人按照 1.787673732 的拆分比例增加基金份额持有人持有的基金份额数。拆分后，基金份额净值变为 1.0000 元，相应地，本基金份额持有人原来每 1 份基金份额拆分后为 1.787673732 份，拆分后基金份额数保留到小数点后 2 位，四舍五入。

## 2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照中华人民共和国财政部颁布的《企业会计准则》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

## 3. 主要会计政策、会计估计

基金份额拆分的主要会计政策：

基金份额拆分于拆分日按拆分前的基金份额数及拆分比例，计算增加的基金份额数，在实收基金科目的数量栏记录。

除基金份额拆分外，本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

## 4. 本报告期重大会计差错的内容和更正金额：无

## 5. 税项

### (1) 印花税

根据财务部、国家税务总局财税字[2005]11 号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，自 2005 年 1 月 24 日起，按 1‰的税率缴纳证券（股票）印花税。

根据财务部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，自 2007 年 5 月 30 日起，按 3‰的税率缴纳证券（股票）印花税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，自 2005 年 6 月 13 日起，对于基金从股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而获得的股权转让，暂免征收印花税。

## (2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，自2005年6月13日起，对于基金从股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等而获得的收入，暂免征收企业所得税。

## (3) 个人所得税

对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税字[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》的规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，自2005年6月13日起，对于基金从股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等而获得的收入，暂免征收个人所得税。

## 6. 关联方关系及关联方交易

### (1) 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、 基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
瑞士信贷	基金管理人股东
中国远洋运输（集团）总公司	基金管理人股东

### (2) 关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### (a) 通过关联方交易单元进行的交易及交易佣金

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行证券交易。

(b) 基金管理费

支付基金管理人工银瑞信基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50 % 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年实际天数

本基金本报告期需支付基金管理费 53,026,564.72 元。

(c) 基金托管费

支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年实际天数

本基金在本报告期需支付基金托管费 8,837,760.80 元。

(d) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 619,162,847.06 元。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 2,184,867.26 元。

(e) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易（单位：元）

关联方名称	交易性质	成交金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	正回购	727,500,000.00	480,575.34

(g) 关联方持有基金份额（单位：份）

1) 基金管理人所持有的本基金份额

	自2007年1月1日至2007年6月30日止
期初持有基金份额	20,008,200.00
加：本期申购	15,759,933.56
其中：基金分红再投资	-
基金拆分增加份额	15,759,933.56
减：本期赎回	-
期末持有基金份额	35,768,133.56
期末持有份额占基金总份额比例	0.32%
申购费率	-

2) 基金管理人主要股东所持有的本基金份额

本报告期本基金管理人主要股东未持有本基金份额。

7. 本基金会计报表重要项目说明（单位：元）

(1) 按活期存款和定期存款披露银行存款项目构成

	2007年6月30日
活期存款	619,162,847.06
定期存款	-
合计	<u>619,162,847.06</u>

(2) 应收利息

	2007年6月30日
应收银行存款利息	106,125.96
应收清算备付金利息	10,986.70
应收债券利息	27,619,710.09
应收银行间买断回购利息	-
应收待回购银行间债券利息	-
其他	-
合计	<u>27,736,822.75</u>

(3) 待摊费用

	2007年6月30日
信息披露费	102,793.02
合计	<u>102,793.02</u>

(4) 投资估值增值

			2007年6月30日
日	市值	成本	估值增值
股票投资	7,526,949,305.33	5,031,021,585.92	2,495,927,719.41
债券投资	1,902,392,657.34	1,901,728,546.20	664,111.14
权证投资	<u>7,273,168.74</u>	<u>2,779,801.57</u>	<u>4,493,367.17</u>
合计	<u>9,436,615,131.41</u>	<u>6,935,529,933.69</u>	<u>2,501,085,197.72</u>

本报告期间,本基金没有因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价减少股票投资成本的情况。

(5) 应付佣金

	2007年6月30日
中信证券股份有限公司	3,946,924.11
中银国际证券有限责任公司	1,229,802.18
中信建投证券有限责任公司	2,598,207.76
招商证券股份有限公司	1,349,757.90
北京高华证券有限责任公司	438,532.60
中国国际金融有限公司	494,694.94
申银万国证券股份有限公司	1,257,473.65
合计	<u>11,315,393.14</u>

(6) 其他应付款

	2007年6月30日
应付券商保证金	750,000.00
银行间交易后台服务费	4,890.00
银行间交易前台服务费	9,280.75
合计	<u>764,170.75</u>

(7) 预提费用

	2007年6月30日
审计费用	39,671.58
合计	<u>39,671.58</u>

(8) 实收基金

	2007年1月1日至2007年6月30日	
	日	
	基金份额数(份)	金额(元)
期初数	6,492,932,768.13	6,492,932,768.13
加: 本期申购	7,015,439,599.53	4,184,193,560.16
基金拆分	2,380,812,032.30	-
减: 本期赎回	4,577,776,388.25	4,349,601,948.53
期末数	<u>11,311,408,011.71</u>	<u>6,327,524,379.76</u>

(9) 未实现利得

	2007年1月1日至2007年6月30日	
期初数		1,840,054,419.63
投资估值增(减)值		401,090,319.67
未实现利得平准金		133,312,603.93
其中: 本期申购		1,311,633,757.95
本期赎回		-1,178,321,154.02
期末数		<u>2,374,457,343.23</u>

(10) 股票差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日	
股票成交总额		6,419,687,052.25
减: 交易佣金		5,413,927.89
股票成本总额		3,910,585,247.12
股票差价收入		<u>2,503,687,877.24</u>

(11) 债券差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日	
债券成交总额		1,378,611,531.37
减: 债券成本总额		1,343,341,320.69
应收利息总额		21,872,689.48
债券差价收入		<u>13,397,521.20</u>

(12) 权证差价收入  
无

(13) 其他收入

2007年1月1日至2007年6月30日

赎回费收入	8,036,309.38
手续费返还	232.80
合计	<u>8,036,542.18</u>

(14) 其他费用

	2007年1月1日 至2007年6月30日
交易费用	31,269.31
审计费用	39,671.58
信息披露费	101,117.46
银行费用	48,570.90
合计	<u>220,629.25</u>

(15) 本期已分配基金净收益

	权益登记日、 除息日	红利发放日	每10份基金份额收 益分配金额(元)	收益分配金额(元)
本报告期第1次分红	2007-01-23	2007-01-24	1.000	596,947,110.90
本报告期第2次分红	2007-06-28	2007-06-29	0.800	751,637,240.08
累计分配金额(元)			1.800	1,348,584,350.98

8. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

(一)截至2007年6月30日止网下申购未流通新股:

序号	流通受限 证券名称	流通受限截止日期	数量(股)	成本总额(元)	报告期末市值(元)
1	天邦股份	2007年7月3日	26,954	276,278.50	562,799.52
2	湘潭电化	2007年7月3日	38,467	250,035.50	685,866.61
3	银轮股份	2007年7月18日	35,867	300,565.46	647,758.02
4	新民科技	2007年7月18日	44,106	414,596.40	800,082.84
5	露天煤业	2007年7月18日	87,837	860,802.60	3,170,915.70
6	中环股份	2007年7月20日	98,899	574,603.19	1,534,912.48
7	沃尔核材	2007年7月20日	15,964	250,954.08	779,841.40
8	利欧股份	2007年7月27日	19,284	263,997.96	584,498.04
9	恒星科技	2007年7月27日	44,423	355,384.00	835,152.40
10	东南网架	2007年8月30日	46,891	450,153.60	1,089,746.84
11	安纳达	2007年8月30日	14,784	119,454.72	337,223.04
12	实益达	2007年9月13日	25,390	261,517.00	1,198,154.10
13	顺络电子	2007年9月13日	19,675	267,580.00	675,049.25
14	N拓邦	2007年9月29日	17,838	186,942.24	1,070,280.00
15	金陵饭店	2007年7月10日	106,196	451,333.00	1,531,346.32
16	连云港	2007年7月26日	138,007	687,274.86	2,014,902.20
17	交通银行	2007年8月15日	533,776	4,216,830.40	5,866,198.24
18	中国远洋	2007年9月26日	973,700	8,256,976.00	17,779,762.00

19	中信银行	2007年7月30日	539,654	3,129,993.20	4,964,816.80
合计			2,827,712	21,575,272.71	46,129,305.80

以上未流通新股因处于网下申购锁定期而暂时流通受限,其年末估值单价是根据最近一个交易日的收盘价确定。

#### 9. 其他事项

无

## 六、 投资组合报告

### (一) 报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
股票	7,526,949,305.33	64.28%
债券	1,902,392,657.34	16.25%
银行存款及清算备付金合计	643,577,664.90	5.50%
权证	7,273,168.74	0.06%
其他资产	1,628,905,248.25	13.91%
资产合计	11,709,098,044.56	100%

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	298,043,420.94	2.68%
C 制造业	3,598,465,674.48	32.30%
C0 食品、饮料	300,810,958.78	2.70%
C1 纺织、服装、皮毛	800,082.84	0.01%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	118,054,204.60	1.06%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	740,238,382.13	6.64%
C5 电子	4,478,395.83	0.04%
C6 金属、非金属	625,297,074.54	5.61%
C7 机械、设备、仪表	746,505,503.40	6.70%
C8 医药、生物制品	1,061,501,230.96	9.53%
C99 其他制造业	779,841.40	0.01%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	168,998,753.56	1.52%
E 建筑业	289,054,801.32	2.59%
F 交通运输、仓储业	547,959,178.93	4.92%
G 信息技术业	431,847,860.00	3.88%

H 批发和零售贸易	770,835,286.35	6.92%
I 金融、保险业	1,162,331,834.91	10.43%
J 房地产业	194,231,655.52	1.74%
K 社会服务业	1,531,346.32	0.01%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	63,649,493.00	0.57%
合计	7,526,949,305.33	67.57%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	23,116,893	568,213,229.94	5.10%
2	000423	东阿阿胶	19,176,948	500,901,881.76	4.50%
3	600309	烟台万华	7,146,701	382,777,305.56	3.44%
4	600276	恒瑞医药	6,800,000	307,632,000.00	2.76%
5	000709	唐钢股份	23,699,923	302,885,015.94	2.72%
6	600315	上海家化	6,895,882	281,834,697.34	2.53%
7	601006	大秦铁路	17,299,916	261,920,728.24	2.35%
8	000063	中兴通讯	4,400,000	239,360,000.00	2.15%
9	600361	华联综超	8,213,000	227,417,970.00	2.04%
10	601166	兴业银行	5,600,000	196,504,000.00	1.76%
11	600588	用友软件	3,942,000	192,487,860.00	1.73%
12	000410	沈阳机床	7,129,713	171,113,112.00	1.54%
13	600825	新华传媒	4,766,967	163,983,664.80	1.47%
14	601318	中国平安	2,192,344	156,774,519.44	1.41%
15	600519	贵州茅台	1,203,097	143,986,648.96	1.29%
16	600500	中化国际	10,020,370	141,387,420.70	1.27%
17	600030	中信证券	2,336,795	123,780,031.15	1.11%
18	000869	张裕A	1,900,000	116,812,000.00	1.05%
19	000039	中集集团	3,786,735	111,027,070.20	1.00%
20	600348	国阳新能	3,000,000	110,880,000.00	1.00%
21	600026	中海发展	4,754,244	109,252,527.12	0.98%
22	000800	一汽轿车	9,845,134	107,311,960.60	0.96%
23	600000	浦发银行	2,903,226	106,229,039.34	0.95%
24	600806	昆明机床	3,931,840	104,980,128.00	0.94%
25	600900	长江电力	6,499,938	98,279,062.56	0.88%
26	600053	中江地产	5,281,264	98,178,697.76	0.88%
27	000024	招商地产	1,966,734	96,566,639.40	0.87%
28	600997	开滦股份	4,379,095	96,340,090.00	0.86%
29	002081	金螳螂	2,188,527	88,679,114.04	0.80%
30	002135	东南网架	3,694,083	85,850,488.92	0.77%
31	000617	石油济柴	2,737,915	84,875,365.00	0.76%

32	600408	安泰集团	9,020,954	74,603,289.58	0.67%
33	601001	大同煤业	2,943,156	74,432,415.24	0.67%
34	002004	华邦制药	3,097,301	74,025,493.90	0.66%
35	600396	金山股份	3,444,700	70,719,691.00	0.63%
36	600824	益民百货	5,996,899	65,306,230.11	0.59%
37	002032	苏泊尔	1,789,543	64,781,456.60	0.58%
38	600415	小商品城	630,193	63,649,493.00	0.57%
39	600694	大商股份	1,000,000	61,550,000.00	0.55%
40	600479	千金药业	2,670,074	61,411,702.00	0.55%
41	000090	深天健	2,767,858	57,848,232.20	0.52%
42	600087	南京水运	4,356,564	56,635,332.00	0.51%
43	600970	中材国际	1,018,454	55,587,219.32	0.50%
44	600150	沪东重机	400,000	55,296,000.00	0.50%
45	000401	冀东水泥	4,003,254	55,084,775.04	0.49%
46	600019	宝钢股份	4,999,930	54,999,230.00	0.49%
47	600211	S藏药业	2,987,871	54,678,039.30	0.49%
48	000651	格力电器	1,535,593	53,592,195.70	0.48%
49	000581	威孚高科	2,913,938	52,101,211.44	0.47%
50	600717	天津港	1,999,925	50,338,112.25	0.45%
51	600009	上海机场	1,315,912	50,017,815.12	0.45%
52	600859	王府井	1,010,420	49,662,143.00	0.45%
53	600582	天地科技	824,164	49,161,382.60	0.44%
54	600748	上实发展	2,207,081	42,949,796.26	0.39%
55	600161	天坛生物	1,327,400	42,622,814.00	0.38%
56	000568	泸州老窖	937,043	39,449,510.30	0.35%
57	600686	金龙汽车	1,473,272	34,621,892.00	0.31%
58	000759	武汉中百	2,500,000	34,000,000.00	0.31%
59	000608	阳光股份	1,464,445	28,966,722.10	0.26%
60	600729	重庆百货	1,014,291	27,527,857.74	0.25%
61	600459	贵研铂业	512,640	26,493,235.20	0.24%
62	600675	中华企业	964,544	21,904,794.24	0.20%
63	002022	科华生物	802,750	20,229,300.00	0.18%
64	600308	华泰股份	808,276	19,875,506.84	0.18%
65	601919	中国远洋	973,700	17,779,762.00	0.16%
66	000625	长安汽车	1,000,000	16,480,000.00	0.15%
67	600268	国电南自	1,000,000	15,740,000.00	0.14%
68	600028	中国石化	1,000,000	13,220,000.00	0.12%
69	000935	四川双马	619,349	9,191,139.16	0.08%
70	601328	交通银行	533,776	5,866,198.24	0.05%
71	601998	中信银行	539,654	4,964,816.80	0.04%
72	600240	华业地产	269,923	3,843,703.52	0.03%
73	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.03%
74	601008	连云港	138,007	2,014,902.20	0.02%

75	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.01%
76	601007	金陵饭店	106,196	1,531,346.32	0.01%
77	002137	实益达	25,390	1,198,154.10	0.01%
78	002135	东南网架	46,891	1,089,746.84	0.01%
79	002139	N拓邦	17,838	1,070,280.00	0.01%
80	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.01%
81	002127	新民科技	44,106	800,082.84	0.01%
82	002130	沃尔核材	15,964	779,841.40	0.01%
83	002125	湘潭电化	38,467	685,866.61	0.01%
84	002138	顺络电子	19,675	675,049.25	0.01%
85	002126	银轮股份	35,867	647,758.02	0.01%
86	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.01%
87	002124	天邦股份	26,954	562,799.52	0.01%
88	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.00%
		股票投资合计:	292,264,713	7,526,949,305.33	67.57%

注：由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### (四) 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额（元）	占期初基金资产净值的比例
1	000709	唐钢股份	297,216,687.31	3.44%
2	601006	大秦铁路	269,272,321.62	3.12%
3	600036	招商银行	219,590,844.55	2.54%
4	601166	兴业银行	215,446,164.60	2.49%
5	600500	中化国际	184,276,469.84	2.13%
6	600030	中信证券	171,069,024.64	1.98%
7	600519	贵州茅台	129,315,245.86	1.50%
8	000800	一汽轿车	120,902,241.65	1.40%
9	601318	中国平安	114,496,930.24	1.32%
10	600026	中海发展	108,415,282.15	1.25%
11	600997	开滦股份	101,847,520.84	1.18%
12	600348	国阳新能	96,082,351.42	1.11%
13	600900	长江电力	95,749,774.23	1.11%
14	600053	中江地产	93,933,127.88	1.09%
15	002135	东南网架	91,135,907.75	1.05%
16	600408	安泰集团	88,837,209.43	1.03%
17	600019	宝钢股份	82,210,165.62	0.95%
18	600761	安徽合力	80,189,995.65	0.93%
19	002004	华邦制药	78,145,429.21	0.90%
20	600824	益民百货	73,255,184.33	0.85%

##### 2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例
----	------	------	-----------	--------------

1	000063	中兴通讯	381,840,871.43	4.42%
2	600309	烟台万华	322,682,067.17	3.73%
3	600036	招商银行	246,306,899.70	2.85%
4	600009	上海机场	240,258,917.67	2.78%
5	600276	恒瑞医药	217,331,724.21	2.51%
6	600361	华联综超	216,556,830.83	2.51%
7	600000	浦发银行	205,679,896.37	2.38%
8	600761	安徽合力	193,145,530.07	2.23%
9	600050	中国联通	184,864,607.07	2.14%
10	600583	海油工程	183,866,199.26	2.13%
11	600519	贵州茅台	173,785,871.43	2.01%
12	600439	瑞贝卡	148,643,602.67	1.72%
13	600718	东软股份	142,153,925.95	1.64%
14	600686	金龙汽车	131,579,405.21	1.52%
15	000869	张裕A	127,863,630.66	1.48%
16	600085	同仁堂	114,260,271.92	1.32%
17	600161	天坛生物	113,469,446.10	1.31%
18	600900	长江电力	111,506,484.79	1.29%
19	600406	国电南瑞	111,049,535.87	1.28%
20	600887	伊利股份	110,147,367.92	1.27%

### 3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
4,230,783,157.35	6,419,687,052.25

#### (五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券类别	债券市值(元)	市值占净值比
1	国债	-	-
2	央行票据	1,516,297,723.69	13.61%
3	企业债券	16,851,507.75	0.15%
5	可转换债	890,475.90	0.01%
6	金融债券	368,352,950.00	3.31%
7	其他债券	-	-
	债券投资合计	1,902,392,657.34	17.08%

#### (六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占净值比
1	07 央行票据 04	524,624,714.79	4.71%
2	06 央行票据 76	243,139,347.95	2.18%
3	07 农发 07	198,500,000.00	1.78%
4	06 央行票据 70	194,560,000.00	1.75%

5	07 央行票据 22	194,138,361.64	1.74%
---	------------	----------------	-------

**(七) 投资组合报告附注**

- 1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,没有 在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
- 2、基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。
- 3、基金其他资产的构成

其他资产	金额(元)
交易保证金	1,680,285.05
应收利息	27,736,822.75
应收申购款	1,599,385,347.43
待摊费用	102,793.02
合计	1,628,905,248.25

- 4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金在本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
- 5、基金报告期末持有的资产支持证券明细  
本报告期末本基金未持有资产支持证券。
- 6、基金报告期内获得权证的数量、成本总额。

(1) 报告期末持有权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(元)	获得方式
1	580013	武钢 CWB1	1,199,599	2,779,801.57	网下申购 07 武钢债送配

(2) 报告期内获得权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(元)	获得方式
1	580013	武钢 CWB1	1,199,599	2,779,801.57	网下申购 07 武钢债送配

7、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本基金募集期认购本基金 20,000,000.00 元,基金份额 20,008,200.00 份,其中认购期间利息转份额 9,200 份,认购费为 1,000 元人民币。本报告期内,由基金拆分增加份额 15,759,933.56 份,基金管理人期末持有的本基金份额为 35,768,133.56 份。

**七、 基金份额持有人情况**

(一) 报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数:	358,616 户
报告期末平均每户持有的基金份额:	31,541.84 份

(二) 报告期末基金份额持有人结构

项目	数量(份)	占总份额的比例
----	-------	---------

基金份额总额：	11,311,408,011.71	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	585,811,350.93	5.18%
个人投资者持有的基金份额	10,725,596,660.78	94.82%

(三) 报告期末本公司基金从业人员持有的基金份额  
 报告期末本公司基金从业人员未持有本基金份额

## 八、 开放式基金份额变动情况

2007年1月1日至2007年6月30日本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	8,369,914,482.23
本报告期期初基金份额总额	6,492,932,768.13
本报告期基金拆分前总申购份额	589,570,859.26
本报告期基金拆分前总赎回份额	4,059,917,042.92
本报告期期间基金拆分增加份额	2,380,812,032.30
本报告期基金拆分后总申购份额	6,425,868,740.27
本报告期基金拆分后总赎回份额	517,859,345.33
本报告期期末基金份额总额	11,311,408,011.71

## 九、 重大事件揭示

1、基金份额持有人大会决议。

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

2、基金管理人、基金托管人的重大人事变动。

1) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大变动

2) 2007年2月27日，经基金管理人第十二次股东会审议通过，Anthony Nimeh Iliya 接替 Lawrence David Haber 担任公司第一届董事会董事，陈晓燕女士接替高明女士担任公司第一届董事会董事，上述董事变更事项已报监管部门备案。

3、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼，如报告期内无诉讼事项，应明确陈述“本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项”。

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 4、基金投资策略的改变。

本报告期内基金投资策略无改变。

#### 5、基金收益分配事项。

	权益登记日、除息日	红利发放日	每 10 份基金份额收益分配金额（元）
本报告期第 1 次分红	2007-01-23	2007-01-24	1.000
本报告期第 2 次分红	2007-06-28	2007-06-29	0.800

#### 6、基金改聘为其审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

7、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形，包括稽查或处罚的次数、原因及结论，如监管部门提出整改意见的，应简单说明整改情况。

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

#### 8、基金租用证券公司专用交易单元的有关情况

##### 1) 基金租用交易单元的选择标准和程序

- a. 券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。
- b. 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。
- c. 券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。工银瑞信精选平衡基金本报告期通过各证券经营机构的交易单元买卖证券的交易量及支付的佣金如下：

##### 2) 股票交易量及佣金（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日）

券商席交易单元	席位 (个)	股票合计(元)	占股票总 量比例	佣金(元)	占佣金总 量比例
申银万国证券股份有限公司	1	1,533,506,528.52	14.51%	1,257,473.65	14.67%
中信证券股份有限公司	1	3,698,557,616.27	35.00%	3,032,521.03	35.38%
中信建投证券有限责任公司	1	2,040,112,881.46	19.31%	1,672,800.47	19.52%
中国国际金融有限公司	1	603,290,522.18	5.71%	494,694.94	5.77%

中银国际证券有限责任公司	1	1,571,616,554.30	14.87%	1,229,802.18	14.35%
招商证券股份有限公司	1	207,305,181.85	1.96%	169,989.83	1.98%
北京高华证券有限责任公司	1	911,738,897.58	8.63%	713,442.44	8.32%
合计	7	10,566,128,182.16	100.00%	8,570,724.54	100.00%

### 3) 债券、权证及回购交易量 (2007年1月1日至2007年6月30日)

券商交易单元	回购金额(元)	占回购总量比例	债券金额(元)	占债券总量比例	权证合计(元)	占权证总量比例
申银万国证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券股份有限公司	50,000,000.00	33.33%	25,725,313.00	34.63%	0.00	0.00%
中信建投证券有限责任公司	100,000,000.00	66.67%	13,694,182.00	18.43%	0.00	0.00%
中国国际金融有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中银国际证券有限责任公司	0.00	0.00%	21,124,587.45	28.44%	0.00	0.00%
招商证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
北京高华证券有限责任公司	0.00	0.00%	13,740,115.40	18.50%	0.00	0.00%
合计	150,000,000.00	100.00%	74,284,197.85	100.00%	0.00	0.00%

工银瑞信基金管理公司的所有基金通过以上券商拥有的交易单元上买卖证券的年交易佣金没有超过工银瑞信当年所有基金买卖证券交易佣金的30%，符合证监会的规定。

### 4) 交易单元变更情况

在报告期内，本基金原使用的中国银河证券股份有限公司交易单元转到本公司旗下管理的其他基金使用。

### 9、其他在报告期内发生的重大事件，以及基金管理人判断为重大事件的事项。

事项	信息披露报纸	披露日期
关于工银瑞信核心价值股票型基金、工银瑞信精选平衡混合型基金、工银瑞信稳健成长股票型基金增聘基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年1月5日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金2006年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年1月19日
工银瑞信基金管理有限公司关于旗下开放式基金在深圳发展银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年1月19日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金第一次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年1月20日
关于对通过中国工商银行网上银行申购工银瑞信核心价值基金、工银瑞信精选平衡基金、工银瑞信稳健成长基金开展费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年1月23日
工银瑞信精选平衡基金在兴业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年1月29日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金更新的招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年2月26日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年2月26日

关于在深圳发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、光大证券股份有限公司开通工银瑞信核心价值基金、工银瑞信货币市场基金和工银瑞信精选平衡基金相互转换的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年3月7日
关于工银瑞信核心价值股票型基金、工银瑞信精选平衡混合型基金、工银瑞信稳健成长股票型基金增聘基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年3月21日
关于基金经理增聘的更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年3月22日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金2006年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年3月30日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金2007年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年4月20日
关于通过中国工商银行股份有限公司开办工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金定期定额投资业务并开展工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金“基金定期定额投资计划申购费优惠”的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年4月21日
工银瑞信基金管理有限公司关于调整旗下基金前端申购费用、申购份额计算方法以及修改基金合同、招募说明书相关条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月16日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金份额拆分和修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月18日
工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金份额拆分的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月21日
工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金份额拆分的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月23日
关于工银瑞信精选平衡基金份额拆分比例的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月25日
关于工银精选基金暂停申购和转换入业务的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月26日
关于工银瑞信精选平衡基金提前结束持续销售及暂停申购和转换入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月28日
工银瑞信精选平衡基金暂停申购及转换入业务期间定期定额投资相关事项的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年5月29日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金关于开发申购和转换入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年6月25日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金第二次分红预告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年6月25日
工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金第二次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007年6月28日

## 十、 备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### （二）存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

### （三）查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：010—65179888，400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

二〇〇七年八月二十七日