

# Disclosure

# 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2006年年度报告摘要

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

**重要提示**

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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3月19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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。

本报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

作出合理的会计估计。

本基金的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3月19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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。

本报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

5、存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按协议规定的利率及提前支取日适用的利率计算，并按提前支取日适用的利率与提前支取本金和已计提利息的差额确认为利息收入，损失计入利息支出。存款利息收入以净额列示。

6、股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除相应的费用后确认入账。

7、买入返售金融资产按买入返售期内实际使用直接法逐日计提的金额入账；

8、其他收入按实际到账的金额入账。

6	60000	浦发银行	10,382.917	220,833,761.27	25.6%
7	60009	工商银行	11,017.342	208,337,072.22	24.1%
8	000003	华泰证券	4,167.281	377,668,313.42	24.0%
9	600588	用友软件	6,469.482	156,572,440.98	23.0%
10	000423	S 阿胶	13,697.820	187,523,156.80	21.7%

<b>(一) 基金基本情况</b>	
1. 基金名称：	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金
2. 基金管理人：	工银瑞信
3. 基金类型：	混合型
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：	6,492,832,768.13份
7. 基金合同存续期：	无
8. 基金份额上市的交易场所：	无
9. 上市日期：	无

<b>第二章 基金简介</b>	
1. 投资目标：	有效控制投资组合风险，追求长期收益与长期资本增值。
2. 投资策略：	本基金采取自上而下的资产配置策略，在资产配置的基础上，根据宏观经济形势、行业景气度、个股估值等因素，进行投资组合的优化调整，力求实现基金资产的长期增值。
3. 业绩比较基准：	60%×沪深300指数收益率+40%×新华富时中国综合指数收益率。
4. 风险收益特征：	本基金属于混合基金，其预期收益及风险水平介于股票型基金和债券型基金之间，属于中风险收益水平。

1. 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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。

2. 基金管理人承诺不从事任何内幕交易、操纵市场和证券欺诈行为，并采取切实有效的手段，防止任何内幕信息的泄露和对基金资产的损害。

3. 基金管理人承诺不从事任何损害基金份额持有人利益的行为，并采取切实有效的手段，防止任何内幕信息的泄露和对基金资产的损害。

4. 基金管理人承诺不从事任何损害基金份额持有人利益的行为，并采取切实有效的手段，防止任何内幕信息的泄露和对基金资产的损害。

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有资产明细数据，请参阅登载于我公司网站的年度报告全文。

四、报告期内基金资产净值及基金份额变动情况

(一) 报告期内基金份额变动情况

序号	项目	2006年
1	基金本期净收益	337,405,801.06元
2	基金份额本期净收益	0.4421元
3	期末可供分配基金收益	310,773,456.92元
4	期末可供分配基金份额收益	0.0479元
5	期末基金资产净值	8,643,760,643.68元
6	期末基金份额净值	1.3313元
7	基金加权平均净值收益率	3.37%
8	本期基金份额净值增长率	33.13%
9	基金份额累计净值增长率	33.13%

<b>第三章 基金业绩表现</b>	
1. 名称：	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第四章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600063	中兴通讯	351,263,221.17	4.06%
2	600301	华资实业	292,157,049.30	3.38%
3	600036	招商银行	266,111,824.28	3.06%
4	600039	浦发银行	250,529,223.03	2.90%
5	600276	恒瑞医药	205,980,597.94	2.38%
6	600009	上海机场	170,556,051.98	1.97%
7	700423	S 阿胶	153,356,378.97	1.77%
8	600588	用友软件	142,804,619.66	1.66%
9	000089	张裕A	139,340,382.41	1.61%
10	600642	国能股份	138,059,465.00	1.57%
11	600000	浦发银行	133,151,848.24	1.54%
12	600050	中国联通	132,353,947.01	1.53%
13	600315	上海医药	126,496,869.60	1.46%
14	600583	海油工程	121,200,276.22	1.40%
15	600085	同仁堂	117,009,213.30	1.35%
16	600039	浦发银行	113,489,476.47	1.31%
17	600825	新华传媒	111,702,127.78	1.29%
18	600519	浦发银行	111,232,129.98	1.29%
19	600410	广汇能源	107,171,354.10	1.24%
20	601006	大秦铁路	101,548,629.40	1.17%

<b>第五章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第六章 财务会计报告</b>		
一、资产负债表(人民币元)		
资产	附注	2006-12-31
银行存款	1	54,434,207.98
清算备付金		11,761,056.30
交易保证金		1,035,348.19
应收证券清算款		113,034,838.98
应收利息		-
应收申购款	2	18,818,763.76
其他应收款		4,460,838.41
其他流动资产		10,985,626.12
总资产	4	6,801,635,025.12
其中：投资组合成本	4	4,710,623,676.69
债券投资成本	4	1,783,715,948.14
其中：债券投资成本	4	1,774,532,419.62
其他流动资产	4	-
买入返售证券		-
待摊费用	3	203,910.48
预收账款		98,039.63
应付证券清算款		8,789,109,926.36
应付利息		126,955,856.62
应付赎回款		478,465.29
应付管理人报酬		10,945,490.63
应付托管费		1,824,248.41
应付利息	5	4,291,960.07
其他应付款		10,985,626.12
其他流动资产	6	768,731.16
预收账款		98,039.63
应付证券清算款	7	84,500.00
应付利息		145,349,252.67
应付股利		34,478,013.64
未交利润	8	6,492,932,768.13
未交利息	9	1,840,054,419.63
未交申购款		310,773,456.92
其他应付款		59,760,401.14
其他流动资产	6	9,958,406.67
预收账款		2,644,919.13
其他流动资产	14	322,341.34
其他流动资产	14	98,039.63
其他流动资产	14	80,000.00
基金净收益		337,405,801.06
加上未实现利得(估值增值)	9	2,099,994,878.06
减去：公允价值变动		2,437,400,679.10

<b>第七章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第八章 基金业绩表现</b>	
1. 名称：	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第九章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十一章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十二章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十三章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十四章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十五章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十六章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十七章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十八章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第十九章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010
5. 国际互联网网址：	http://www.icbcs.com.cn
6. 法定代表人：	杨国祥
7. 总经理：	杨国祥
8. 信息披露负责人：	朱东旭
9. 联系电话：	010-66179888
10. 传真：	010-85159188
11. 电子邮箱：	customerservice@icbcs.com.cn

<b>第二十章 基金管理人</b>	
1. 名称：	工银瑞信基金管理有限公司
2. 注册地：	北京市西城区金融大街26号
3. 办公地址：	北京市东城区朝内大街188号润兴大厦
4. 邮政编码：	100010