

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

[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，并对其中内容的真实性、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。

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2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 工银沪深300指数

交易代码 481009

基金运作方式 灵活配置开放式

基金合同生效日 2009年3月5日

报告期末基金份额总额 4,283,935,242.27份

投资目标 采用指数化投资，通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，实现对标的指数的有效跟踪，追求基金资产的长期增值。

本基金在原则上实行完全复制策略，即按照标的指数的成份股及其权数被动地进行投资组合，并定期地对指数成分股及其权重的变动进行调整，但因特殊情况下导致成分股无法获得足额数量的股票时，基金管理人将运用其拥有的投资权限构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+商业银行银行后活期存款利率×5%

风险收益特征 本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数的表现，目标为争取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

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

§3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日—2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -44,569,483.06

2.本期利润 64,509,199.07

3.加权平均基金份额本期利润 0.0147

4.期末基金份额净值 3,737,865,247.48

5.期末基金份额净值 0.8725

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“本期已实现收益”指本基金利息收入、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所列数据截至2012年6月30日。

④基金净值表现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。

⑤本基金各项投资比例符合基金合同的规定：投资于股票资产占基金资产的比例不低于80%，但因法规限制原因，导致本基金不能投资相关股票，而致使本基金不能达到上述比例的情形除外。现金、债券、货币资产占基金资产的比例为5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

⑥本期利润指报告期利息收入、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。

⑦所列数据截至2012年6月30日。

⑧基金净值表现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。

⑨本基金各项投资比例符合基金合同的规定：投资于股票资产占基金资产的比例不低于80%，但因法规限制原因，导致本基金不能投资相关股票，而致使本基金不能达到上述比例的情形除外。现金、债券、货币资产占基金资产的比例为5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

⑩本基金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

⑪本基金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

⑫本基金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

⑬本基金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

⑭本基金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

⑮本基金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

⑯本基金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

⑰本基金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

⑱本基金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

⑲本基金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

⑳本基金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

㉑本基金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

㉒本基金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

㉓本基金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

㉔本基金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

㉕本基金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

㉖本基金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

㉗本基金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

㉘本基金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

㉙本基金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

㉚本基金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

㉛本基金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

㉜本基金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

㉝本基金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

㉞本基金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

㉟本基金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

㉟本基金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