

2012年10月25日 星期四

深证红利交易型开放式指数证券投资基金

[2012] 第三季度报告

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:二〇一二年十月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书在所任职的公司不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性承担个别法律责任。本公司根据《基金合同》约定，于2012年10月23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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据《基金合同》约定，于2012年10月23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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银深证红利ETF
交易代码	159905
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年1月5日
报告期末基金份额总额	1,277,443,951.00份

注:基金投资对象为股票型基金,本基金为指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数相似的一致的投资收益。

投资目标 本基金采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股所占比重及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

业绩比较基准 深证红利价格指数

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。本基金主要采用完全复制策略,跟踪标的指数的表现,是股票基金区别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 中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-	-16,783,641.43	
2.本期利润	-84,483,940.92	-0.0665	
3.加权平均基金份额本期利润	857,666,725.85	0.6714	
4.期末基金份额净值	855,763.13	0.9954	

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;“期初利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益”

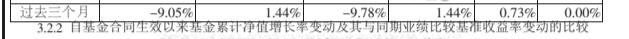
3.所列数据截止至2012年9月30日。

4.本期基金份额净值=报告期每份额可供分配利润/报告期每份额净资产。

5.3.1 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-9.05%	1.44%	-9.78%	1.44%	0.73%	0.00%

5.3.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其同期间业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同于2010年11月5日生效。
2.根据本基金成立以来的净值增长率,本基金在2010年11月5日至2012年9月30日期间,累计净值增长率为-9.05%,而同期S&P 500 Fund Index的累计净值增长率为-9.78%。

3.本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其同期间业绩比较基准收益率变动的比较

5.3.3 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-9.05%	1.44%	-9.78%	1.44%	0.73%	0.00%

5.3.4 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.5 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.6 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.7 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.8 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.9 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.10 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.11 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.12 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.13 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.14 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.15 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.16 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.17 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.18 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.19 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.20 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.21 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.22 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.23 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.24 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.25 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.26 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.27 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.28 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.29 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.30 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.31 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.32 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.33 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.34 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.35 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.36 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.37 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.38 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.39 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.40 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.41 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.42 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.43 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.44 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.45 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.46 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.47 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.48 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.49 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.50 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.51 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.52 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.53 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.54 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.55 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.56 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.57 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.58 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.59 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.60 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.61 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.62 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.63 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.64 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.65 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.66 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.67 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.68 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.69 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.70 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.71 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.72 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.73 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.74 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.75 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.76 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.77 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.78 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.79 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.80 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.81 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.82 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.83 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.84 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较

5.3.85 本报告期基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率的比较