

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:二〇一二年三月二十九日

重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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该基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要披露年度报告正文，投资者欲了解详细内容，阅读年度报告正文。

本报告期自2011年01月01日起至2011年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 工银深证红利ETF

基金代码 159905

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2010年11月5日

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 11,358,443,951.00份

基金合同存续期 不定期

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2011年1月11日

2.2 基金产品说明

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。业绩表现与标的指数表现相一致的长期投资收益率。

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的构成及其权重比例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。基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，在正常情况下，本基金对标的指数的跟踪目标是：努力使得基金份额的年平均收益率与业绩基准的年平均收益率偏离度不超过0.1%，偏离度年度化标准差不超过2%。

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。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

风险收益特征

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 工银瑞信基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

姓名 朱頂き 李芳菲

信息披露义务人 联系电话 010-58698918 010-66060069

电子邮箱 customer@icbccs.com.cn lifangfei@abcchina.com

客户服务电话 010-58698918 95599

传真 010-66583158 010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 www.icbccs.com.cn

基金年度报告备置地点 基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2011年 2010年11月5日-2010年12月31日 2009年

本期已实现收益 -43,672,732.00 343,950.80 -

本期利润 -464,653,629.50 2,122,032.77 0.0055

加权平均基金份额本期利润 -0.3683 0.314% 0.35%

本期基金份额净值 938,725,576.34 609,565,983.77 -

期末基金份额净值 0.6910 1.0035 -

注1:所涉基金业收入指标不包括持有入股或购买交易基的各项目费用,计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价值变动收益;

3.本基金合同生效日为2010年11月5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

注2:本基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 基金合同到期日效以来基金份额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

3.2.3 基金合同到期日效以来基金份额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

3.2.4 基金合同到期日效以来基金份额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

3.2.5 基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注3:本基金合同于2010年11月5日生效,根据基金合同规定,本基金建仓期为3个月。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同第十四条(三)投资范围、(四)投资限制的规定;本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。法律允许的情况下,本基金还可以将其纳入投资范围。其中,基金资产投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

3.2.6 基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注4:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注5:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注6:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注7:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注8:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注9:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注10:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注11:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注12:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注13:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注14:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注15:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注16:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注17:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注18:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注19:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注20:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注21:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注22:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注23:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注24:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注25:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注26:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注27:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注28:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注29:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注30:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注31:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注32:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注33:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注34:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注35:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注36:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注37:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注38:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注39:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注40:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注41:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注42:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注43:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注44:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注45:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注46:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注47:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注48:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注49:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注50:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注51:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注52:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注53:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注54:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注55:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注56:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注57:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注58:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注59:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注60:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注61:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注62:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注63:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注64:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注65:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注66:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注67:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注68:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注69:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注70:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注71:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注72:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注73:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注74:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注75:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注76:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注77:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注78:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注79:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注80:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注81:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注82:本基金合同到期日效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较