

## 深证红利交易型开放式指数证券投资基金

## [2014] 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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董监高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、准确性负责。但其个别董事并不代表基金管理人。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于二〇一四年十月二十三日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务数据未经审计。

报告期自2014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
场内简称	深证红利
交易代码	159905
基金运作方式	交易型开放式
基金份额总额	3,098,443,951.00份
报告期末基金份额总额	3,098,443,951.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与业绩基准一致的长期投资收益。
投资策略	本基金将完全复制标的指数的构成,即按照标的指数的成分股及其权重比例购买并持有该指数成份股,并定期根据标的指数成份股的调整情况相应地进行调整。
业绩比较基准	深证红利指数
风险收益特征	本基金为指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪标的指数的收益波动,因此其预期收益及风险水平与标的指数的收益波动基本一致。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)				
1.本期已实现收益		-5,743,613.51			
2.本期利润	76,060,515.95				
3.期初平准基金额份额本期利润	0.0809				
4.期末基金份额净值	661,280,286.69				
5.期末基金份额净值	0.7360				

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,计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

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;“本期利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。”

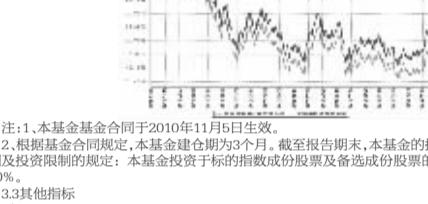
3.所列数据截至2014年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金期基金额份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①		业绩比较基准收益率②		①-②	②-④
	增长③	增长④	增长⑤	增长⑥		
过去三个月	12.08%	1.00%	11.79%	1.03%	0.29%	-0.03%

3.2.2 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



注:1.本基金基金合同于2010年11月5日生效。

2.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关于投资范围及投资限制的规定:本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%。

3.其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
何江	指数投资部总监、本基金的基金经理	2011年5月25日	-	9
赵相	本基金的基金经理	2012年10月9日	-	6

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守纪的说明

本基金报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行

为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金

管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及内部规定,制定了《公平交易管理制度》。

4.4 报告期内基金的估值政策和程序说明

本基金报告期内,基金的估值政策和程序均符合法律法规和公司制度的规定。

4.5 管理人对宏观经济的展望说明

本基金本报告期无宏观经济分析,运用宏观经济分析判断投资策略,通过运用定

量分析方法、技术分析和对导致股票下跌原因的深入研究,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权证投资	657,727,613.21	99.34
2	银行存款	657,727,613.21	99.34
3	应收利息	-	-
4	应付债券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他资产	-	-
8	合计	662,073,279.83	100.00

注:1.本基金基金合同于2006年12月10日生效。

2.根据合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为本基金的建仓期,截至报告期末,本基金的各项投资符合基金合同关于投资范围及

投资限制的规定:本基金股票占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%-40%;现金或者到期日

在一年内的政府债券不高于基金资产净值的5%。

3.其他指标

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	报告期期初基金份额总额	报告期期间新申购基金份额总额	报告期期间赎回基金份额总额	报告期末基金份额总额
1	981,443,951.00	71,446,883.12	10,073,279.83	992,817,554.11

注:1.报告期期间新申购基金份额总额、报告期期间赎回基金份额总额的计算公式为:报告期期间新申购基金份额总额=报告期期间新申购基金份额×报告期期间每份基金份额净值;报告期期间赎回基金份额总额=报告期期间赎回基金份额×报告期期间每份基金份额净值;报告期末基金份额总额=报告期期初基金份额总额+报告期期间新申购基金份额总额-报告期期间赎回基金份额总额。

2.报告期期间基金份额变动幅度的计算公式为:报告期基金份额变动幅度=(报告期末基金份额总额-报告期期初基金份额总额)/报告期期初基金份额总额×100%。

3.报告期期间基金份额变动百分比的计算公式为:报告期基金份额变动百分比=报告期基金份额变动幅度×100%。

4.报告期期间基金份额变动比例的计算公式为:报告期基金份额变动比例=报告期基金份额变动百分比/报告期期间新申购基金份额总额×100%。

5.报告期期间基金份额变动情况的说明

本基金本报告期无基金份额变动情况。

6.报告期期间基金份额变动原因的说明

本基金本报告期无基金份额变动原因。

7.报告期期间基金份额变动对基金份额净值的影响

本基金本报告期无基金份额变动对基金份额净值的影响。

8.影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准深证红利交易型开放式指数证券投资基金设立的文件;

2.深证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议;

3.深证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议;

4.基金管理人业务资格批件和营业执照;

5.基金托管人业务资格批件和营业执照;

6.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.基金代销机构的名单及地址;

8.基金募集申请表;

9.基金上市交易公告书;

10.基金定期报告、半年度报告和年度报告;

11.临时公告和澄清公告;

12.基金季度报告;

13.基金半年度报告和年度报告。

9.2 备查文件

无。

§ 10 备查文件

无。

§ 11 备查文件

无。

§ 12 备查文件

无。

§ 13 备查文件

无。

§ 14 备查文件

无。

§ 15 备查文件

无。

§ 16 备查文件

无。

§ 17 备查文件

无。

§ 18 备查文件

无。

§ 19 备查文件

无。

§ 20 备查文件

无。

§