

# 工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

## 2015] 第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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、完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人的董事、监事及高级管理人员所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金销售机构和代销机构的名称、地址、联系方式等信息，保留在本报告中不存虚假记载、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其未来表现。投资人投资于基金，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。

报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称 工银深证100指数分级  
场内简称 工银100  
交易代码 164811  
基金运作方式 管理型开放式  
基金合同生效日 2012年10月25日  
报告期末基金份额总额 15,617,023.02份

基金份额净值 申购赎回费收取情况：通过申购赎回费用，为不份额赎回提供具有差异化收益风险的激励机制。

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其未来表现。投资人投资于基金，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。

报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

### § 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(2015年1月1日—2015年3月31日)

1.本期已实现收益 4,230,684.94

2.本期利润 4,972,524.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.2189

4.期末基金资产净值 22,757,106.30

5.期末基金份额净值 1.4072

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将低于不计费用的水平。

(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，本期利息收入指报告期利息收入减去利息支出(赎回费、交易佣金、卖出回购证券产生的费用、支付的手续费、税金、借款利息、买入返售证券产生的费用、支付的手续费、税金、赎回费等)。

(3) 本基金在存续期内的每个会计年度，基金合同生效日在所处会计年度外，7月份的第一个工作日对登记在册的基金份额持有人100份，深证100A份每份赎回的基金资产，基金管理人收取0.1%的赎回费。

(4) 所列期间截止至2015年3月31日。

3.21 报告期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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 非净值标准差③ 收益率差④ 收益率差标准差⑤ ①-③ ②-④

过去三个月 20.96% 1.60% 22.27% 1.55% -1.31% 0.05%

3.22 基金合同生效以来基金总份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金总份额自2012年10月25日成立以来净值增长率为140.72%，同期业绩比较基准收益率为139.55%。

3.3 其他指标

4.1 管理人报告

4.1.1 基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同，招募说明书等有关规定履行的义务，依照诚信、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.1.2 公平交易制度的执行情况

本公司报告期内，本基金不存在有损公平交易的情况。

4.1.3 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.4 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.5 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.6 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.7 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.8 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.9 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.10 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.11 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.12 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.13 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.14 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.15 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.16 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.17 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.18 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.19 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.20 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.21 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.22 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.23 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.24 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.25 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.26 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.27 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.28 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.29 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.30 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.31 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.32 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.33 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.34 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.35 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.36 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.37 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.38 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.39 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.40 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.41 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.42 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.43 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.44 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.45 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.46 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.47 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.48 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.49 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.50 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.51 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.52 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.53 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.54 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.55 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.56 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.57 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.58 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.59 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.60 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.61 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。

4.1.62 投资组合的监督和业绩评价

本公司报告期内，本基金不存在不公平交易的情况。