

工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及本基金报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性承担个别连带责任。

基金托管人:中国银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2016年1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，保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金投资人承诺以其真实有效的财产认购基金份额，不得以任何方式损害基金持有人的利益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告书的摘要部分已经审计。

本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:工银中铁产业股票型分级基金

场内简称:高铁母基

交易代码:164818

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年7月21日

报告期末基金份额总额:412,979,394.12份

基金资产净值:412,979,394.12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追踪。通过对标的指数成份股的配置提供具有差异化的收益风险回报。

投资策略:本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，同时可少量投资于非成份股，以期在控制风险的前提下，获得超越标的指数的收益。本基金对标的指数的跟踪目标是：力图使得基金净值与标的指数的日均涨跌幅平均误差不超过4%。

业绩比较基准:中证高铁产业指数收益率×95%+金融期权工具获取的收益×5%。

风险收益特征:本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金，低于股票型基金，具有较高的风险，预期收益率具有高风险、高预期收益的特征。

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

下属分级基金简称:高铁A端 高铁B端 高铁母基

下属分级基金交易代码:150325 150326 164820

下属分级基金报告期末基金份额:601,519,332.00份 166,519,332.00份 79,939,730.12份

总资产:661,978,069.00元

净资产:412,979,394.12份

基金份额净值:1.000

注:(1)上述本基金的各项费用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所列数字。(2)“本期已实现收益”指本基金本期利息收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。(3)本期平均基金份额本期利润=本期利润/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。(4)本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 596,406.12

2.本期利润 -3,416,324.03

3.期初平均基金份额本期利润 -0.00120

4.期末基金份额净值 312,419,622.41

5.期末基金份额净值 1.000

注:1.上述本基金的各项费用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所列数字。

2.本期已实现收益”指本基金本期利息收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额本期利润=本期利润/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 596,406.12

2.本期利润 -3,416,324.03

3.期初平均基金份额本期利润 -0.00120

4.期末基金份额净值 312,419,622.41

5.期末基金份额净值 1.000

注:1.上述本基金的各项费用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所列数字。

2.本期已实现收益”指本基金本期利息收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额本期利润=本期利润/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 596,406.12

2.本期利润 -3,416,324.03

3.期初平均基金份额本期利润 -0.00120

4.期末基金份额净值 312,419,622.41

5.期末基金份额净值 1.000

注:1.上述本基金的各项费用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所列数字。

2.本期已实现收益”指本基金本期利息收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额本期利润=本期利润/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值 349,601,360.49

5.期末基金份额净值 0.10

注:1.上期基金利润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所列数字。

2.本期已实现收益”指本期收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额净值=报告期末基金份额净值/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值 349,601,360.49

5.期末基金份额净值 0.10

注:1.上期基金利润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所列数字。

2.本期已实现收益”指本期收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额净值=报告期末基金份额净值/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值 349,601,360.49

5.期末基金份额净值 0.10

注:1.上期基金利润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所列数字。

2.本期已实现收益”指本期收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额净值=报告期末基金份额净值/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值 349,601,360.49

5.期末基金份额净值 0.10

注:1.上期基金利润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所列数字。

2.本期已实现收益”指本期收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额净值=报告期末基金份额净值/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值 349,601,360.49

5.期末基金份额净值 0.10

注:1.上期基金利润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所列数字。

2.本期已实现收益”指本期收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额净值=报告期末基金份额净值/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值 349,601,360.49

5.期末基金份额净值 0.10

注:1.上期基金利润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所列数字。

2.本期已实现收益”指本期收入、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，年末在存续期间的第1个工作日在《本期利润》中列示。

3.本期平均基金份额净值=报告期末基金份额净值/报告期总份额，截至报告期末未进行基金份额折算。

4.本期份额净值=报告期末基金份额总额/报告期末基金份额总份额。

5.报告期:2015年10月1日—2015年12月31日

6.单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年10月1日—2015年12月31日)

1.本期已实现收益 -11,442,361.27

2.本期利润 79,496,536.17

3.期初平均基金份额本期利润 0.20268

4.期末基金份额净值