

## 深证红利交易型开放式指数证券投资基金

## [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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年一月二十日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，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内容，保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金经理承诺承认真实、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。投资者有风险，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。

本公司未对本报告所载资料进行审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信红利ETF
场内简称	深证红利
交易代码	159906
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
报告期末基金份额总额	231,443,961.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，实现跟踪误差和跟踪误差最小化，力争实现与业绩基准相当的一致的回报。
投资策略	本基金采用完全复制策略，即根据标的指数的构成及其权重建立相应的投资组合，并根据标的指数成份股价格变动情况进行相应调整。
业绩比较基准	深证红利指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金为指数基金，风险与货币市场指数表现一致。
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

3.1 主要财务指标

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.本期实现收入 1,461,499.48

2.本期利润 69,053,204.29

3.加权平均基金份额本期利润 0.3066

4.期末基金份额净值 289,340,891.25

5.期末基金份额总额 1,246.65

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"指基金本期利润收入，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.所有数据截至到2015年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内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 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 32.06% 2.01% 33.02% 2.03% -0.92% -0.02%

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

图示:深证红利指数与沪深300指数的历史走势对比

注:1.本基金合同于2010年11月6日生效。

2.根据基金合同约定，本基金在成立后的95个交易日后，截至本报告期末，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%。

3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 离任日期 证券从业年限 说明

赵相 本基金的基金经理 2012年10月9日 - 8 2008年加入工银瑞信，曾任风险管理部研究员，2010年1月加入工银瑞信基金管理有限公司，2012年10月9日至至今任本基金基金经理。2010年1月1日至至今任工银瑞信基金管理有限公司上海铭络软件有限公司(以下简称“铭络系统”)安邦三个交易网关、对于上交所大宗交易系统、深交所大宗交易系统、以及银行间大宗交易系统的有效管理，对大宗客户大额资金操作了严格的控制，确保了系统的正常运行。2012年1月1日至至今任工银瑞信基金管理有限公司铭络系统产品经理，负责铭络系统中123个客户HOMS系统，包括客户经理的主账户、对账客户账户、发送客户账户等铭络系统的真实、完整性、安全性、可读性，未能确保客户交易终端数据与铭络系统数据的一致性。2015年6月10日，广发证券已知悉并关注HOMS系统存在的系统安全隐患及客户投诉反映的问题，广发证券已向客户发送了公告，提醒客户及时更换密码，未能确保客户身份识别等相关问题，广发证券已向客户发送了公告，提醒客户及时更换密码，未能确保客户身份识别等相关问题。

4.2 公平交易制度的执行情况

4.3 基金投资组合的重大关联交易情况

4.4 投资组合报告

4.5 投资组合报告的披露情况

4.6 投资组合报告的披露时间安排

4.7 投资组合报告的披露说明

4.8 投资组合报告的披露频率

4.9 投资组合报告的披露说明

4.10 投资组合报告的披露说明

4.11 投资组合报告的披露说明

4.12 投资组合报告的披露说明

4.13 其他指标

## § 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) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 282,601,400.07 97.86%

2 固定收益投资 252,691,400.75 97.85%

3 国库券投资 - -

4 货币市场工具投资 - -

5 银行存款 - -

6 其他投资 - -

7 衍生金融工具投资 - -

8 其他资产 - -

9 合计 288,804,560.00 100.00%

注:1.本基金投资组合项下可替代货币估值的停牌股票。

2.由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.1 重要财务指标

3.2.1 报告期内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 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 20.93% 1.58% 18.92% 1.60% 2.01% -0.02%

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

图示:深证红利指数与沪深300指数的历史走势对比

注:1.本基金投资组合项下可替代货币估值的停牌股票。

2.根据基金合同约定，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%。

3.3 其他指标

## § 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额 233,943,961.00

报告期期间基金总申购份数 19,000,000.00

减报告期间基金赎回份数 21,500,000.00

报告期期间基金净申购变动数(分母数减去分子数) -

报告期末基金份额总额 231,443,961.00

注:1.报告期内基金总申购份额和赎回份额以单个交易日成交的95%的百分比计算。

2.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

3.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

4.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

5.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

6.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

7.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

8.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

9.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

10.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

11.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

12.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

13.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

14.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

15.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

16.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

17.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

18.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

19.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

20.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

21.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

22.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

23.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

24.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

25.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

26.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

27.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

28.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

29.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

30.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

31.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

32.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

33.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

34.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

35.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

36.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

37.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

38.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

39.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

40.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

41.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

42.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

43.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

44.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

45.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

46.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

47.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

48.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

49.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

50.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

51.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

52.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

53.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

54.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

55.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

56.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

57.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

58.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

59.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

60.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

61.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

62.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

63.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

64.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

65.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

66.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

67.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

68.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

69.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

70.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

71.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

72.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

73.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

74.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

75.报告期间基金份额变动的申购赎回情况

76.报告期间基金份额变动