

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

[2015]第四季度报告

2015年12月31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董事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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,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内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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。
本基金合同自2015年10月1日起至2012年31日止。
本报告期自2015年10月1日起至2012年31日止。

§ 2 基金产品概况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,940,328.80	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,940,328.80	0.18

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001318	中国平安	2,894,268	104,194,368.00	3.73
2	600016	民生银行	7,028,086	76,434,248.00	2.74
3	601166	兴业银行	3,612,121	61,075,976.47	2.21
4	600036	招商银行	2,830,932	50,928,466.63	1.82
5	000002	万科A	2,036,104	49,717,688.44	1.78
6	601328	交通银行	7,161,824	46,122,146.56	1.66
7	600000	浦发银行	2,524,433	46,121,390.01	1.65
8	601288	农业银行	12,779,834	41,279,863.02	1.48
9	600030	中证银行	2,102,324	40,699,280.70	1.46
10	601988	中国银行	8,602,158	34,494,629.52	1.23

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.3 基金投资组合报告

5.3.4 主要财务指标

5.3.5 报告期内基金资产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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率差(%)
过去三个月	16.76%	1.61%	15.65%	1.16%

5.3.6 5.3.7 5.3.8 5.3.9 5.3.10 5.3.11 5.3.12 5.3.13 5.3.14 5.3.15 5.3.16 5.3.17 5.3.18 5.3.19 5.3.20 5.3.21 5.3.22 5.3.23 5.3.24 5.3.25 5.3.26 5.3.27 5.3.28 5.3.29 5.3.30 5.3.31 5.3.32 5.3.33 5.3.34 5.3.35 5.3.36 5.3.37 5.3.38 5.3.39 5.3.40 5.3.41 5.3.42 5.3.43 5.3.44 5.3.45 5.3.46 5.3.47 5.3.48 5.3.49 5.3.50 5.3.51 5.3.52 5.3.53 5.3.54 5.3.55 5.3.56 5.3.57 5.3.58 5.3.59 5.3.60 5.3.61 5.3.62 5.3.63 5.3.64 5.3.65 5.3.66 5.3.67 5.3.68 5.3.69 5.3.70 5.3.71 5.3.72 5.3.73 5.3.74 5.3.75 5.3.76 5.3.77 5.3.78 5.3.79 5.3.80 5.3.81 5.3.82 5.3.83 5.3.84 5.3.85 5.3.86 5.3.87 5.3.88 5.3.89 5.3.90 5.3.91 5.3.92 5.3.93 5.3.94 5.3.95 5.3.96 5.3.97 5.3.98 5.3.99 5.3.100 5.3.101 5.3.102 5.3.103 5.3.104 5.3.105 5.3.106 5.3.107 5.3.108 5.3.109 5.3.110 5.3.111 5.3.112 5.3.113 5.3.114 5.3.115 5.3.116 5.3.117 5.3.118 5.3.119 5.3.120 5.3.121 5.3.122 5.3.123 5.3.124 5.3.125 5.3.126 5.3.127 5.3.128 5.3.129 5.3.130 5.3.131 5.3.132 5.3.133 5.3.134 5.3.135 5.3.136 5.3.137 5.3.138 5.3.139 5.3.140 5.3.141 5.3.142 5.3.143 5.3.144 5.3.145 5.3.146 5.3.147 5.3.148 5.3.149 5.3.150 5.3.151 5.3.152 5.3.153 5.3.154 5.3.155 5.3.156 5.3.157 5.3.158 5.3.159 5.3.160 5.3.161 5.3.162 5.3.163 5.3.164 5.3.165 5.3.166 5.3.167 5.3.168 5.3.169 5.3.170 5.3.171 5.3.172 5.3.173 5.3.174 5.3.175 5.3.176 5.3.177 5.3.178 5.3.179 5.3.180 5.3.181 5.3.182 5.3.183 5.3.184 5.3.185 5.3.186 5.3.187 5.3.188 5.3.189 5.3.190 5.3.191 5.3.192 5.3.193 5.3.194 5.3.195 5.3.196 5.3.197 5.3.198 5.3.199 5.3.200 5.3.201 5.3.202 5.3.203 5.3.204 5.3.205 5.3.206 5.3.207 5.3.208 5.3.209 5.3.210 5.3.211 5.3.212 5.3.213 5.3.214 5.3.215 5.3.216 5.3.217 5.3.218 5.3.219 5.3.220 5.3.221 5.3.222 5.3.223 5.3.224 5.3.225 5.3.226 5.3.227 5.3.228 5.3.229 5.3.230 5.3.231 5.3.232 5.3.233 5.3.234 5.3.235 5.3.236 5.3.237 5.3.238 5.3.239 5.3.240 5.3.241 5.3.242 5.3.243 5.3.244 5.3.245 5.3.246 5.3.247 5.3.248 5.3.249 5.3.250 5.3.251 5.3.252 5.3.253 5.3.254 5.3.255 5.3.256 5.3.257 5.3.258 5.3.259 5.3.260 5.3.261 5.3.262 5.3.263 5.3.264 5.3.265 5.3.266 5.3.267 5.3.268 5.3.269 5.3.270 5.3.271 5.3.272 5.3.273 5.3.274 5.3.275 5.3.276 5.3.277 5.3.278 5.3.279 5.3.280 5.3.281 5.3.282 5.3.283 5.3.284 5.3.285 5.3.286 5.3.287 5.3.288 5.3.289 5.3.290 5.3.291 5.3.292 5.3.293 5.3.294 5.3.295 5.3.296 5.3.297 5.3.298 5.3.299 5.3.300 5.3.301 5.3.302 5.3.303 5.3.304 5.3.305 5.3.306 5.3.307 5.3.308 5.3.309 5.3.310 5.3.311 5.3.312 5.3.313 5.3.314 5.3.315 5.3.316 5.3.317 5.3.318 5.3.319 5.3.320 5.3.321 5.3.322 5.3.323 5.3.324 5.3.325 5.3.326 5.3.327 5.3.328 5.3.329 5.3.330 5.3.331 5.3.332 5.3.333 5.3.334 5.3.335 5.3.336 5.3.337 5.3.338 5.3.339 5.3.340 5.3.341 5.3.342 5.3.343 5.3.344 5.3.345 5.3.346 5.3.347 5.3.348 5.3.349 5.3.350 5.3.351 5.3.352 5.3.353 5.3.354 5.3.355 5.3.356 5.3.357 5.3.358 5.3.359 5.3.360 5.3.361 5.3.362 5.3.363 5.3.364 5.3.365 5.3.366 5.3.367 5.3.368 5.3.369 5.3.370 5.3.371 5.3.372 5.3.373 5.3.374 5.3.375 5.3.376 5.3.377 5.3.378 5.3.379 5.3.380 5.3.381 5.3.382 5.3.383 5.3.384 5.3.385 5.3.386 5.3.387 5.3.388 5.3.389 5.3.390 5.3.391 5.3.392 5.3.393 5.3.394 5.3.395 5.3.396 5.3.397 5.3.398 5.3.399 5.3.400 5.3.401 5.3.402 5.3.403 5.3.404 5.3.405 5.3.406 5.3.407 5.3.408 5.3.409 5.3.410 5.3.411 5.3.412 5.3.413 5.3.414 5.3.415 5.3.416 5.3.417 5.3.418 5.3.419 5.3.420 5.3.421 5.3.422 5.3.423 5.3.424 5.3.425 5.3.426 5.3.427 5.3.428 5.3.429 5.3.430 5.3.431 5.3.432 5.3.433 5.3.434 5.3.435 5.3.436 5.3.437 5.3.438 5.3.439 5.3.440 5.3.441 5.3.442 5.3.443 5.3.444 5.3.445 5.3.446 5.3.447 5.3.448 5.3.449 5.3.450 5.3.451 5.3.452 5.3.453 5.3.454 5.3.455 5.3.456 5.3.457 5.3.458 5.3.459 5.3.460 5.3.461 5.3.462 5.3.463 5.3.464 5.3.465 5.3.466 5.3.467 5.3.468 5.3.469 5.3.470 5.3.471 5.3.472 5.3.473 5.3.474 5.3.475 5.3.476 5.3.477 5.3.478 5.3.479 5.3.480 5.3.481 5.3.482 5.3.483 5.3.484 5.3.485 5.3.486 5.3.487 5.3.488 5.3.489 5.3.490 5.3.491 5.3.492 5.3.493 5.3.494 5.3.495 5.3.496 5.3.497 5.3.498 5.3.499 5.3.500 5.3.501 5.3.502 5.3.503 5.3.504 5.3.505 5.3.506 5.3.507 5.3.508 5.3.509 5.3.510 5.3.511 5.3.512 5.3.513 5.3.514 5.3.515 5.3.516 5.3.517 5.3.518 5.3.519 5.3.520 5.3.521 5.3.522 5.3.523 5.3.524 5.3.525 5.3.526 5.3.527 5.3.528 5.3.529 5.3.530 5.3.531 5.3.532 5.3.533 5.3.534 5.3.535 5.3.536 5.3.537 5.3.538 5.3.539 5.3.540 5.3.541 5.3.542 5.3.543 5.3.544 5.3.545 5.3.546 5.3.547 5.3.548 5.3.549 5.3.550 5.3.551 5.3.552 5.3.553 5.3.554 5.3.555 5.3.556 5.3.557 5.3.558 5.3.559 5.3.560 5.3.561 5.3.562 5.3.563 5.3.564 5.3.565 5.3.566 5.3.567 5.3.568 5.3.569 5.3.570 5.3.571 5.3.572 5.3.573 5.3.574 5.3.575 5.3.576 5.3.577 5.3.578 5.3.579 5.3.580 5.3.581 5.3.582 5.3.583 5.3.584 5.3.585 5.3.586 5.3.587 5.3.588 5.3.589 5.3.590 5.3.591 5.3.592 5.3.593 5.3.594 5.3.595 5.