工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金

【2016】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:二〇一六年四月二十二日

§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4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证500指数		
场内简称	工银500		
交易代码	164809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年1月31日		
报告期末基金份额总额	38,411,979.56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跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。		
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.35%,偏离度年化标准差不超过4%。		
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征,睿智A份额具有低风险、低预期收益的特征;睿智B份额具有高风险、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	500A	500B	工银500
下属分级基金交易代码	150055	150056	164809
下属分级基金报告期末基金份额总额	2,394,206.00份	3,591,310.00份	32,426,463.56份

§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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-635,625.39
2.本期利润	-10,826,031.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2856
4.期末基金资产净值	50,278,010.42
5.期末基金份额净值	1.3089

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、本基金在存续期内的每个会计年度(基金合同生效日所在会计年度除外)的第一个工作日对登记在册的睿智中证500份额、睿智中证500A份额进行基金的定期份额折算。

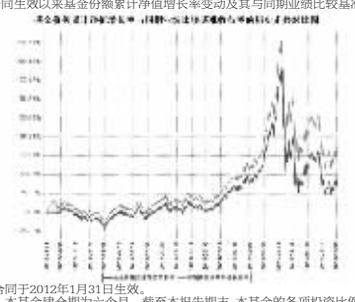
4、所列数据截止到2016年3月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	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	-18.67%	3.13%	-18.20%	3.08%	-0.47%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2012年1月31日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为六个月。截至本报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定:本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%,其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于90%;现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为5%-10%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	本基金的基金经理	2014年10月17日	-	6	中国人民大学金融工程博士;2010年加入工银瑞信,历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理,现任指数投资部基金经理。2014年10月17日至今,担任工银深证100指数分级基金基金经理;2014年10月17日至今,担任工银沪深300指数基金基金经理;2014年10月17日至今,担任工银中证500指数分级基金基金经理;2015年5月21日至今,担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理;2015年7月23日至今,担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.07%,偏离度年化标准差为1.52%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成分股票的调整等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-18.67%,业绩比较基准收益率为-18.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

§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	46,755,521.25	92.14
	其中:股票	46,755,521.25	92.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,937,793.65	7.76
8	其他资产	51,341.46	0.10
9	合计	50,744,656.36	100.00

注: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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	933,988.00	1.86
B	采矿业	1,707,719.55	3.40
C	制造业	27,674,427.11	55.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,348,752.10	2.68
E	建筑业	1,333,604.48	2.65
F	批发和零售业	2,799,164.30	5.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,380,125.03	2.74
H	住宿和餐饮业	106,574.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,788,678.30	5.55
J	金融业	464,617.90	0.92
K	房地产业	3,088,894.65	6.14
L	租赁和商务服务业	825,114.12	1.64
M	科学研究和技术服务业	211,096.96	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	337,273.96	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	135,000.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	632,106.00	1.26
S	综合	597,769.85	1.19
	合计	46,364,906.31	92.22

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。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	390,614.94	0.78
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	-	-
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	390,614.94	0.78

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。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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 报告期末指数投资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	002466	天齐锂业	2,100	352,380.00	0.70
2	000748	长城信息	12,600	296,730.00	0.59
3	600654	中安消	8,600	248,024.00	0.49
4	600201	生物股份	7,600	235,144.00	0.47
5	600079	人福医药	11,900	221,340.00	0.44
6	002085	万丰奥威	6,000	213,840.00	0.43
7	002405	四维图新	7,510	198,939.90	0.40
8	600584	长电科技	10,500	196,245.00	0.39
9	600816	安信信托	11,700	196,209.00	0.39
10	600673	东阳光科	22,900	196,024.00	0.39

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002018	华信国际	8,400	208,320.00	0.41
2	000982	中银绒业	22,177	182,294.94	0.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,943.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	971.05
5	应收申购款	42,426.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,341.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600654	中安消	248,024.00	0.49	重大事项
2	002405	四维图新	198,939.90	0.40	重大事项
3	600584	长电科技	196,245.00	0.39	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	208,320.00	0.41	重大事项
2	000982	中银绒业	182,294.94	0.36	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	500A	500B	工银500
报告期期初基金份额总额	2,167,122.00	3,250,684.00	30,630,798.90
报告期期间基金总申购份额	-	-	5,502,190.73
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	3,746,583.47
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	227,084.00	340,626.00	40,057.40
报告期期末基金份额总额	2,394,206.00	3,591,310.00	32,426,463.56

注:1.拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算调整份额,报告期末基金份额总额为三级份额之和;

2.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

3.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额;

4.本基金于2016年1月4日进行了定期折算。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金在2016 年1 月4 日办理定期份额折算业务。详见基金管理人官网2015年12月29日《关于工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》。

根据2016年1月5日《关于工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金之A份额2016年度约定年基准收益率的公告》,500A份额2016年约定年基准收益率为5.00%(=1.50%+3.5%)。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信睿智中证500指数分级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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

深证红利交易型开放式指数证券投资基金

【2016】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银深证红利ETF
场内简称	深红利
交易代码	159905
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	176,943,951.00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,力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证红利价格指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。
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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	2,047,249.57
2.本期利润	-33,160,960.49
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1697
4.期末基金资产净值	196,672,744.22
5.期末基金份额净值	1.1115

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。

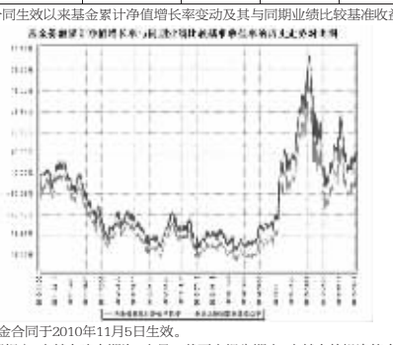
3、所列数据截止到2016年3月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	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	-10.78%	2.13%	-11.34%	2.32%	0.56%	-0.19%

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票及备选成份股票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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵栩	本基金的基金经理	2012年10月9日	-	8	2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部金融工程分析师,2011年10月18日至今担任工银上证央企ETF基金基金经理;2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF基金基金经理;2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF连接基金基金经理,2013年5月28日至今担任工银普金球自然指数基金基金经理,2015年7月9日至今担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理,2015年7月9日至今担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-10.78%,业绩比较基准收益率为-11.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§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	194,354,820.30	98.61
	其中:股票	194,354,820.30	98.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,738,250.57	1.39
8	其他资产	6,508.43	0.00
9	合计	197,099,579.30	100.00

注:1、股票投资项含可退替代款估值增值。

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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

序号	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	1,510,798.83	0.77
C	制造业	94,836,517.86	48.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	991,404.80	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,191,679.58	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	40,615,373.58	20.65
K	房地产业	50,630,113.65	25.74
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	4,578,932.00	2.33
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	194,354,820.30	98.82

注:1、合计项不含可退替代款估值增值;

2、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。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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 报告期末指数投资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	000002	万 科A	1,638,846	40,037,007.78	20.36
2	000651	格力电器	987,082	18,971,716.04	9.65
3	000001	平安银行	1,243,988	13,236,032.32	6.73
4	000333	美的集团	407,121	12,559,682.85	6.39
5	000776	广发证券	587,135	9,816,897.20	4.99
6	000858	五 粮 液	346,511	9,740,424.21	4.95
7	000783	长江证券	662,930	6,814,920.40	3.47
8	000100	TCL集团	1,671,600	6,402,228.00	3.26
9	000166	申万宏源	681,341	6,057,121.49	3.08
10	002304	洋河股份	88,420	5,906,456.00	3.00

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

广发证券:

违规行为:

2014年9月,广发证券对杭州恒生网络技术服务有限责任公司HOMS系统(以下简称HOMS系统)开放接入。同年12月,广发证券上海分公司对该系统开放专线接入,2015年5月19日,专线连通。2015年3月30日,广发证券上海分公司为上海铭创软件技术有限公司系统(以下简称铭创系统)安装第三个交易网关。对于上述外部接入的第三方交易终端软件,广发证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。截止调查日,广发证券客户中有123个使用HOMS系统、铭创系统接入的主账户。对上述客户,广发证券未采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。2015年5月25日,广发证券已知悉并关注HOMS系统等系统存在引发违规配资及违反账户实名制管理有关规定等问题,广发证券在未采集上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。

处分类型:

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,证监会拟决定:对广发证券责令整改,给予警告,没收违法所得 6805135.75 元,并处以20415407.25元罚款。

投资决策流程符合公司的制度要求,目前公司经营状况良好,业绩稳定,对投资无重大影响。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,861.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	646.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,508.43

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	40,037,007.78	20.36	重大事项
2	000651	格力电器	18,971,716.04	9.65	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	231,443,951.00
报告期期间基金总申购份额	32,500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	87,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	176,943,951.00

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§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基金合同》;

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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2016】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	工银深证红利ETF联接
交易代码	481012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月9日
报告期末基金份额总额	161,660,845.09份
投资目标	主要投资本基金之目标ETF基金,采用指数化投资,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金的主要资产将投资于目标ETF份额,该部分资产占基金资产的比例不低于90%,本基金不参与目标ETF的投资管理。
业绩比较基准	深证红利价格指数收益率×95%+银行活期存款税