

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

2012第三季度报告

2012年9月30日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事局及董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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月23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。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银沪深300指数
交易代码	481009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月1日
报告期末基金份额总额	4,618,027,794.75份
投资目标	采取指数化投资，力争将基金投资组合相对于标的指数的偏离度、跟踪误差控制在合理的范围内，从而在一定程度上实现基金净值的增值。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的构成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股的调整和变化定期或不定期地进行相应调整，同时可能适当调整股票投资组合的构成比例，以降低跟踪误差。基金管理人将运用其他合理的投资方法和投资工具进行风险管理，以期在一定程度上降低投资风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+人民币银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险收益水平高于货币市场基金、债券基金与货币市场基金；本基金为指数型基金，风险收益特征与标的指数相似，即股票型基金平均收益水平是股票型基金净值增长率的下限，股票型基金平均收益水平是股票型基金净值增长率的上限。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-11,265,325.09
2.本期利润	-232,682,877.98
3.期初至报告期基金份额累计净值	-0.0522
4.期末基金份额净值	3,783,764,936.77
5.期末基金份额总值	8,019.03

注：1.本基金业绩比较基准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.本期已实现收益为本基金利息收入、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2012年9月30日。

4.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.2.2.3 报告期未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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	中国平安	2,610,760	109,495,774.40	2.86
2	民生银行	19,002,720	107,266,424.00	2.80
3	招商银行	10,237,676	104,014,788.16	2.75
4	交通银行	21,128,360	90,006,813.60	2.39
5	贵州茅台	323,591	79,538,667.80	2.10
6	兴业银行	5,883,805	70,664,998.05	1.87
7	工商银行	9,062,926	66,884,933.88	1.77
8	万科A	7,545,110	63,665,277.30	1.68
9	中信证券	5,366,283	63,268,500.15	1.67
10	海通证券	6,307,241	60,423,688.78	1.60

4.2.2.4 报告期未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

4.2.2.5 报告期未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组合

4.2.2.6 本报告期内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况。

4.2.2.7 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体本期未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

4.2.2.8 本报告期内基金投资的前十名债券的名称未超出基金合同规定的备选债券库。

4.2.2.9 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收保证金	10,000,000.00
2	应收证券清算款	800,906.10
3	应收红利	489,230.53
4	应收申购款	635,011.49
5	应收赎回款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,925,147.82

4.2.2.10 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.11 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.12 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.13 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.14 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.15 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.16 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.17 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.18 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.19 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.20 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.21 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.22 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.23 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.24 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.25 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.26 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.27 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.28 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.29 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.30 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.31 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.32 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.33 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.34 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.35 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.36 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.37 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.38 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.39 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.40 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.41 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.42 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.43 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.44 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.45 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.46 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.47 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.48 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.49 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.50 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.51 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.52 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.53 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.54 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.55 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.56 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.57 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.58 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.59 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.60 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.61 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.62 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.63 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.64 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.65 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.66 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.67 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.68 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.69 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.70 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.71 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.72 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.73 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.74 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

4.2.2.75 本报告期内基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的