

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

2013第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

\$1 重要提示

基金管理人和基金托管人根据法律法规及基金合同规定，于2013年10月21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。

基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金财产的运作情况、资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金收益、费用等信息可在规定报刊上查阅或登录基金管理人网站查询。

本基金中财资料未经审计。

本基金报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信沪深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3月5日
报告期末基金份额总额	2,488,081,905.04份

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，实现对标的指数的紧密跟踪，追求基金资产的长期增值。

本基金在原则上采行完全复制策略，即按照标的指数的构成及其权重，购买并持有的股票、债券等金融工具，以使得基金的收益与标的指数的收益相一致。但因特殊原因导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用其他合理的投资方法构造基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行活期利率×5%

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，本基金为指数型基金，跟踪标的指数的市场表现，目标为获取市场平均收益水平，基金净值在一定程度上低于中等风险水平的基金净值。

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

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)

1.本期已实现收益 -112,901,626.51

2.本期利润 245,751,415.80

3.加权平均基金份额本期利润 0.0761

4.期末基金份额净值 2,483,281,590.78

5.期末基金资产净值 0.8689

注:1.本期业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于定期报告所示数值。

2.本期利润是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.所列数据截止至2013年9月30日。

4.2 基金净值表现

3.2 本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

3.2.1 日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 ② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 9.88% 1.39% 9.01% 1.36% 0.87% 0.03%

3.2.2 日基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.4 未来不确定性的说明

3.5 其他指标

5.1 管理人报告

4.1 基金经理(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

何江 指数投资部副总监、基金经理 2011年5月25日 - 8

首先在北京方正信诚金融有限公司担任高级分析师，诚信信评评估师，2006年加入工银瑞信，现担任指数投资部副总监，曾任风险管理部投资经理，2011年5月25日至2012年1月10日担任工银瑞信沪深300指数基金的基金经理，2012年1月10日至2013年5月25日在担任工银深证100指数投资基金的基金经理，2013年5月25日至2013年7月10日担任工银瑞信沪深300指数基金的基金经理，2013年7月10日至2013年9月30日担任工银瑞信沪深300指数基金的基金经理。

5.2 管理人对报告期内基金运作的说明

5.2.1 本报告期内基金运作符合法律法规及基金合同的规定，本基金报告期内没有投资组合参与的交易行为公开竞价日同向反交易成交较少的单笔交易未被认定为异常交易行为。

5.2.2 本报告期内基金运作无操纵市场行为。

5.2.3 本报告期内基金的异常交易行为

5.3 本报告期内基金的估值政策

5.4 本报告期内基金管理人对报告期内基金投资组合的评价

5.5 本报告期内基金的业绩表现

5.6 本报告期内基金的费用计提、支付和归属情况

5.7 本报告期内基金的税收清算情况

5.8 本报告期内基金的费用情况说明

5.9 本报告期内基金的费用情况说明

5.10 本报告期内基金的费用情况说明

5.11 本报告期内基金的费用情况说明

5.12 本报告期内基金的费用情况说明

5.13 本报告期内基金的费用情况说明

5.14 本报告期内基金的费用情况说明

5.15 本报告期内基金的费用情况说明

5.16 本报告期内基金的费用情况说明

5.17 本报告期内基金的费用情况说明

5.18 本报告期内基金的费用情况说明

5.19 本报告期内基金的费用情况说明

5.20 本报告期内基金的费用情况说明

5.21 本报告期内基金的费用情况说明

5.22 本报告期内基金的费用情况说明

5.23 本报告期内基金的费用情况说明

5.24 本报告期内基金的费用情况说明

5.25 本报告期内基金的费用情况说明

5.26 本报告期内基金的费用情况说明

5.27 本报告期内基金的费用情况说明

5.28 本报告期内基金的费用情况说明

5.29 本报告期内基金的费用情况说明

5.30 本报告期内基金的费用情况说明

5.31 本报告期内基金的费用情况说明

5.32 本报告期内基金的费用情况说明

5.33 本报告期内基金的费用情况说明

5.34 本报告期内基金的费用情况说明

5.35 本报告期内基金的费用情况说明

5.36 本报告期内基金的费用情况说明

5.37 本报告期内基金的费用情况说明

5.38 本报告期内基金的费用情况说明

5.39 本报告期内基金的费用情况说明

5.40 本报告期内基金的费用情况说明

5.41 本报告期内基金的费用情况说明

5.42 本报告期内基金的费用情况说明

5.43 本报告期内基金的费用情况说明

5.44 本报告期内基金的费用情况说明

5.45 本报告期内基金的费用情况说明

5.46 本报告期内基金的费用情况说明

5.47 本报告期内基金的费用情况说明

5.48 本报告期内基金的费用情况说明

5.49 本报告期内基金的费用情况说明

5.50 本报告期内基金的费用情况说明

5.51 本报告期内基金的费用情况说明

5.52 本报告期内基金的费用情况说明

5.53 本报告期内基金的费用情况说明

5.54 本报告期内基金的费用情况说明

5.55 本报告期内基金的费用情况说明

5.56 本报告期内基金的费用情况说明

5.57 本报告期内基金的费用情况说明

5.58 本报告期内基金的费用情况说明

5.59 本报告期内基金的费用情况说明

5.60 本报告期内基金的费用情况说明

5.61 本报告期内基金的费用情况说明

5.62 本报告期内基金的费用情况说明

5.63 本报告期内基金的费用情况说明

5.64 本报告期内基金的费用情况说明

5.65 本报告期内基金的费用情况说明

5.66 本报告期内基金的费用情况说明

5.67 本报告期内基金的费用情况说明

5.68 本报告期内基金的费用情况说明

5.69 本报告期内基金的费用情况说明

5.70 本报告期内基金的费用情况说明

5.71 本报告期内基金的费用情况说明

5.72 本报告期内基金的费用情况说明

5.73 本报告期内基金的费用情况说明

5.74 本报告期内基金的费用情况说明

5.75 本报告期内基金的费用情况说明

5.76 本报告期内基金的费用情况说明

5.77 本报告期内基金的费用情况说明

5.78 本报告期内基金的费用情况说明

5.79 本报告期内基金的费用情况说明

5.80 本报告期内基金的费用情况说明

5.81 本报告期内基金的费用情况说明

5.82 本报告期内基金的费用情况说明

5.83 本报告期内基金的费用情况说明

5.84 本报告期内基金的费用情况说明

5.85 本报告期内基金的费用情况说明

5.86 本报告期内基金的费用情况说明

5.87 本报告期内基金的费用情况说明

5.88 本报告期内基金的费用情况说明

5.89 本报告期内基金的费用情况说明

5.90 本报告期内基金的费用情况说明

5.91 本报告期内基金的费用情况说明

5.92 本报告期内基金的费用情况说明

5.93 本报告期内基金的费用情况说明

5.94 本报告期内基金的费用情况说明

5.95 本报告期内基金的费用情况说明

5.96 本报告期内基金的费用情况说明

5.97 本报告期内基金的费用情况说明

5.98 本报告期内基金的费用情况说明

5.99 本报告期内基金的费用情况说明

5.10 本报告期内基金的费用情况说明

5.11 本报告期内基金的费用情况说明

5.12 本报告期内基金的费用情况说明

5.13 本报告期内基金的费用情况说明

5.14 本报告期内基金的费用情况说明

5.15 本报告期内基金的费用