

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

2014 第四季度 报告

2014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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年一月二十一日

基金管理人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2015年1月19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预示其未来表现。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。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

2.1 基金产品情况

Table with 2 columns: 基金名称, 工银瑞信深证红利ETF联接基金. Includes details on fund type, investment objective, and risk profile.

2.1.1 目标基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 工银瑞信深证红利ETF. Includes details on fund type, investment objective, and risk profile.

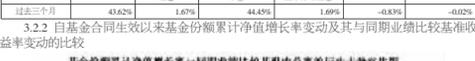
2.1.2 目标基金产品说明

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists fund managers and their roles.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵约情况的说明

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,恪尽职守,勤勉尽责...

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...

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.01%,偏离度年化标准差为0.25%。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)指数中成份股票的调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为43.62%,业绩比较基准收益率为44.45%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

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《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。

5.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 工银瑞信深证红利ETF. Includes details on fund type, investment objective, and risk profile.

5.2.1 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 工银瑞信深证红利ETF. Includes details on fund type, investment objective, and risk profile.

5.2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征.

5.3 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

5.3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

5.4 管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists fund managers and their roles.

5.4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵约情况的说明

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,恪尽职守,勤勉尽责...

5.4.3 公平交易专项说明

5.4.3.1 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...

5.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.01%,偏离度年化标准差为0.27%。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)指数中成份股票的调整等。

5.4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为46.41%,业绩比较基准收益率为47.19%。

5.4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

5.4.6 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《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。

5.5 投资组合报告

5.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

5.5.2 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

5.5.3 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

5.5.3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

5.6 开放式基金投资组合

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

5.6.1 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

5.6.2 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

5.6.3 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

5.6.3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

5.7 基金管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists fund managers and their roles.

5.7.2 管理人对于报告期内本基金运作遵约情况的说明

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,恪尽职守,勤勉尽责...

5.7.3 公平交易专项说明

5.7.3.1 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...

5.7.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.7.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.01%,偏离度年化标准差为0.27%。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)指数中成份股票的调整等。

5.7.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为46.41%,业绩比较基准收益率为47.19%。

5.7.4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

5.7.4.6 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《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。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

5.9 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联接基金设立的文件;
2.《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基金合同》;
3.《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托管协议》;
4.基金管理人业务资格批准和营业执照;
5.基金托管人业务资格批准和营业执照;
6.报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告。

5.9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

5.9.3 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。

2.基金募集情况

Table with 2 columns: 基金募集期间, 基金募集日期. Lists fund collection details.

3.基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.1 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.2 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.3 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

3.3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

3.4 基金管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists fund managers and their roles.

3.4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵约情况的说明

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,恪尽职守,勤勉尽责...

3.4.3 公平交易专项说明

3.4.3.1 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...

3.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

3.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.01%,偏离度年化标准差为0.27%。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)指数中成份股票的调整等。

3.4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为46.41%,业绩比较基准收益率为47.19%。

3.4.4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

3.4.4.6 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《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。

3.5 影响投资者决策的其他重要信息

3.6 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联接基金设立的文件;
2.《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基金合同》;
3.《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托管协议》;
4.基金管理人业务资格批准和营业执照;
5.基金托管人业务资格批准和营业执照;
6.报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告。

3.6.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

3.6.3 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。

2.基金募集情况

Table with 2 columns: 基金募集期间, 基金募集日期. Lists fund collection details.

3.基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.1 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.2 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.3 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

3.3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

3.4 基金管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists fund managers and their roles.

3.4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵约情况的说明

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,恪尽职守,勤勉尽责...

3.4.3 公平交易专项说明

3.4.3.1 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...

3.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

3.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.01%,偏离度年化标准差为0.27%。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)指数中成份股票的调整等。

3.4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为46.41%,业绩比较基准收益率为47.19%。

3.4.4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

3.4.4.6 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《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。

3.5 影响投资者决策的其他重要信息

3.6 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联接基金设立的文件;
2.《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基金合同》;
3.《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托管协议》;
4.基金管理人业务资格批准和营业执照;
5.基金托管人业务资格批准和营业执照;
6.报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告。

3.6.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

3.6.3 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。

2.基金募集情况

Table with 2 columns: 基金募集期间, 基金募集日期. Lists fund collection details.

3.基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.1 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.2 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.3 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年10月1日至2014年12月31日).

3.3.2 自基金合同生效以来基金业绩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9日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资比例符合基金合同的规定...

3.4 基金管理人报告

Table with 2 columns: 姓名, 职务. Lists fund managers and their roles.

3.4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵约情况的说明

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,恪尽职守,勤勉尽责...

3.4.3 公平交易专项说明

3.4.3.1 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...

3.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

3.4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.01%,偏离度年化标准差为0.27%。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)指数中成份股票的调整等。

3.4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为46.41%,业绩比较基准收益率为47.19%。

3.4.4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用量化分析等技术、分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

3.4.4.6 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《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。

3.5 影响投资者决策的其他重要信息

3.6 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联接基金设立的文件;
2.《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基金合同》;
3.《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托管协议》;
4.基金管理人业务资格批准和营业执照;
5.基金托管人业务资格批准和营业执照;
6.报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告。

3.6.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

3.6.3 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。

2.基金募集情况

Table with 2 columns: 基金募集期间, 基金募集日期. Lists fund collection details.

3.基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.1 基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目. Lists asset categories and their values.

3.2 基金资产组合情况