工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银聚焦30股票
交易代码	001496
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月25日
报告期末基金份额总额	1,005,810,201.94份
投资目标	本基金通过特续、系统、深入、全面的基本面研究精选个股,在科学的风险管理体系下,集中投资于具有长期发展潜力和估值优势的上市公司股票,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将科学、系统、规范的行业研究及选股方法与积极主动的投资风格相结合,采用自下而上精选个股并集中投资的策略,同时辅以自上而下资产配置和行业配置策略,在有效控制风险的前提下,实现超越业绩基准的收益。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,757,642.34
2.本期利润	-105,676,107.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0946
4.期末基金资产净值	916,698,907.67
5.期末基金份额净值	0.911

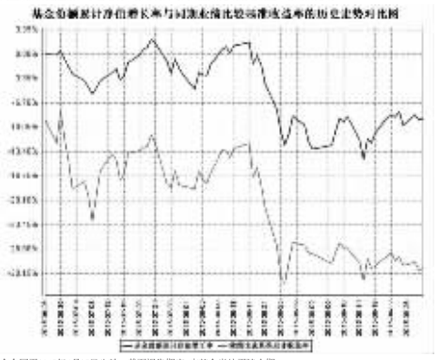
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、"本期已实现收益"指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;"本期利润"为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所列数据截止到2015年9月30日。

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	-9.35%	1.66%	-23.37%	2.73%	14.02%	-1.07%

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2015年6月25日生效。截至报告期末,本基金尚处于建仓期。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例为80%-95%。其中投资于基金持仓比例最高的前30只股票的资产不低于非现金基金资产的80%。任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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的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		
胡文彪	本基金的基金经理	2015年6月25日	-	14	先后在国泰君安证券股份有限公司担任研究员,华林证券有限公司担任研究员;2006年加入工银瑞信基金管理有限公司,历任产品开发部高级经理和权益投资部高级经理;2009年3月5日至2011年2月10日,担任工银沪深300基金基金经理;2009年8月26日至2011年2月10日,担任工银上证央企ETF基金基金经理;2010年2月10日至2011年3月16日,担任工银双利债券基金基金经理;2011年3月16日至今,担任工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金经理;2012年11月20日至今,担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理;2013年11月12日至今,担任工银瑞信精选平衡混合基金经理;2015年4月28日至今,担任工银瑞信养老产业股票型基金基金经理;2015年6月25日至今,担任工银聚焦30股票型基金基金经理。

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3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 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本报告期内,基金净值增长率为-9.35%,业绩比较基准收益率为-23.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
当前中国经济下行的主要压力来自产业结构转型升级所要求的"去产能",特别是地产大周期拐点到来对应的地产投资下滑。由于这些因素的变化更多是趋势性而非周期性,所以我们认为年内宏观经济的内生增长动能尚难见明显改观,仍将大概率维持弱势。此外,6月以来股市的大幅调整等短期因素也将在边际上加大下半年经济增长的下行压力。不过随着二季度以来政府稳增长政策已经陆续发力(包括地产政策放松、地方政府债务置换规模明确并扩容、降息降准、对政策性银行注资、发行基础设施建设专项债、以及调低固定资产投资资本金要求等),我们预计,四季度经济环比将有所改善,但幅度有限。在宏观经济整体需求依然疲弱的背景下,消费者物价指数(CPI)通胀上行风险有限,工业品出厂价格指数(PPI)通缩压力更值得忧虑。为此货币政策将大概率继续以中性偏松为主基调,财政政策也将维持实质性积极。

在宏观经济增长偏弱的环境下,上半年股票市场的上涨主要来自股指提升和过高的短期预期,而最直接的因素来自大量资金进入股票市场。监管层在4月下旬、6月中旬逐步规范场外融资、配资市场,引发股市大幅下跌。当前场外融资市场绝大部分已清理,场内融资融券余额减少一半以上。股市调整到位后,我们仍然看好改革红利、技术进步、经济转型环境下的成长股票投资机会,主要行业包括通信、国防军工、传媒、环保、计算机等快速成长性行业和医疗保健、家电、商贸零售、食品饮料等稳健成长性行业,包括智慧城市、北斗信息、通用航空、体育健身、养老产业、互联网教育、互联网汽车、信息安全、新能源车、数字营销等子行业,以及国企改革、电力体制改革、民参军等主题投资。本基金主要投资具有快速成长的个股,并相对集中持有,力争取得相对收益,并在市场反弹过程中能够取得更大收益。

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	375,130,904.18	40.67
	其中:股票	375,130,904.18	40.67
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	546,373,541.83	59.24
8	其他资产	788,521.59	0.09
9	合计	922,292,967.60	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

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	8,561,900.11	0.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	204,404,913.55	22.30
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	31,861,082.37	3.48
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	66,189,345.52	7.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,050,000.00	1.10
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	43,720,296.20	4.77
S	综合	10,343,366.43	1.13
	合计	375,130,904.18	40.92

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

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	002664	信质电机	679,926	16,454,209.20	1.79
2	300329	海伦钢琴	750,601	16,212,981.60	1.77
3	300075	数字政通	650,000	15,242,500.00	1.66
4	000681	视觉中国	560,000	14,828,800.00	1.62
5	300104	乐视网	349,997	14,307,877.36	1.56
6	300334	津膜科技	570,000	13,782,600.00	1.50
7	300351	永贵电器	579,933	13,187,676.42	1.44
8	600038	中直股份	300,000	12,735,000.00	1.39
9	002273	水晶光电	679,866	12,230,789.34	1.33
10	601933	永辉超市	1,199,925	12,179,238.75	1.33

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	139,272.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111,249.13
5	应收申购款	538,000.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	788,521.59

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
本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	1,271,582,011.55
报告期期间基金总申购份额	53,600,599.88
减:报告期期间基金总赎回份额	319,372,409.49
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	1,005,810,201.94

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、中国证监会准予工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、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处。
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。

工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:中国银河证券股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月9日(基金合同生效日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证新能源指数分级		
场内简称	新能母基		
交易代码	164821		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月9日		
报告期末基金份额总额	91,325,911.72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)难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	中证新能源指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型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,跟踪标的指数表现,目标为获取指数的平均收益,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收益特征。工银瑞信A份额具有低风险、低预期收益的特征;工银瑞信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	中国银河证券股份有限公司		
下属分级基金简称	新能A级	新能B级	新能母基
下属分级基金交易代码	150327	150328	164821
下属分级基金报告期末基金份额总额	14,343,678.00份	14,343,679.00份	62,638,554.72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(2015年7月9日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,317,760.61
2.本期利润	-20,468,071.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1239
4.期末基金资产净值	71,346,993.07
5.期末基金份额净值	0.7812

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工银新能源份额、工银新能源A份额进行基金的定期份额折算。截至本报告期末未进行基金份额折算。
(4)所列数据截止到2015年9月30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	-21.88%	2.23%	-0.91%	4.05%	-20.97%	-1.82%

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2015年7月9日生效。截至报告期末,本基金尚处于建仓期。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证新能源指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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的5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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	2015年7月9日	-	7	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日至今担任工银标普全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3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 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
本报告期内,基金净值增长率为-21.88%,业绩比较基准收益率为-0.91%。

4.5 管理人对宏观经济、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,通过运用定量分析等技术、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	22,776,002.34	30.86
	其中:股票	22,776,002.34	30.86
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	41,000,000.00	55.56
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,818,027.86	13.30
7	其他资产	203,221.65	0.28
8	合计	73,797,251.85	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	采矿业	-	-
C	制造业	19,166,063.34	26.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,342,604.00	1.88
E	建筑业	162,175.00	0.23
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	742,137.00	1.04
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	613,340.00	0.86
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	749,683.00	1.05
	合计	22,776,002.34	31.92

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	601727	上海电气	106,000	1,190,380.00	1.67
2	002594	比亚迪	16,800	1,008,168.00	1.41
3	002176	江特电机	120,780	981,941.40	1.38
4	600089	特变电工	92,900	979,166.00	1.37
5	601106	中国一重	93,800	814,184.00	1.14
6	000939	凯迪电力	88,600	800,058.00	1.12
7	000559	万向钱潮	41,100	796,518.00	1.12
8	002202	金风科技	55,101	744,414.51	1.04
9	600406	国电南瑞	52,300	742,137.00	1.04
10	000541	佛山照明	70,400	672,320.00	0.94

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	173,024.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,457.85
5	应收申购款	9,900.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	14,838.73
8	其他	-
9	合计	203,221.65

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	002176	江特电机	981,941.40	1.38	重大事项
2	000939	凯迪电力	800,058.00	1.12	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
无。

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	新能A级	新能B级	新能母基
基金合同生效日(2015年7月9日)基金份额总额	89,239,630.00	89,239,631.00	89,706,153.24
报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	3,844,882.44
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	180,704,384.96
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-74,895,952.00	-74,895,952.00	149,791,904.00
报告期期末基金份额总额	14,343,678.00	14,343,679.00	62,638,554.72

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,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。

§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
本基金自基金合同生效日(2015年7月9日)起至报告期期末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、中国证监会准予工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信中证新能源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、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、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处。
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。

工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月9日(基金合同生效日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证环保产业指数分级		
场内简称	环保母基		
交易代码	164819		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月9日		
报告期末基金份额总额	89,347,994.30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)难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	中证环保产业指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型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,跟踪标的指数表现,目标为获取指数的平均收益,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收益特征。工银环保A份额具有低风险、低预期收益的特征;工银环保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	招商证券股份有限公司		
下属分级基金简称	环保A端	环保B端	环保母基
下属分级基金交易代码	150323	150324	164819
下属分级基金报告期末基金份额总额	12,652,177.00份	12,652,178.00份	64,043,639.30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(2015年7月9日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-10,117,653.17
2.本期利润	-21,155,912.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1327
4.期末基金资产净值	72,200,820.29
5.期末基金份额净值	0.8081

注:(1)