

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

2013第四季度报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会及监事会在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2014年1月17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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告中财务资料未经审计。

2.1 基金产品概况

基金简称	工银沪深300指数
交易代码	481009
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金合同生效日	2009年5月6日
报告期末基金份额总额	7,248,623,511.09份

投资目标 采取指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的跟踪,为投资者提供一个低风险、低成本的指数化投资工具。

投资策略 本基金将在做足完全复制策略,即按照标的指数的构成及其权重来构建基金投资组合,并根据标的指数成分股的权重的变动进行相应调整,使因

特许经营权变化导致基金无法获得足夠数据的时段内,基金管理人将运用其他合理的投资方法,如资产配置等方法,对基金资产进行投资。

业绩比较基准 沪深300指数×90%+银行存款利息×10%。

风险收益特征 本基金属于股票型基金,风险收益特征与沪深300指数相似,风险收益特征与股票型基金平均收益、股票型基金净值增长率等指标表现相似,目标为获取市场平均收益,跟踪

股票型基金净值增长率等于等于净值的基金产品。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标和净值表现

单位:人民币元	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-41,507,334.96
2.本期利润	-77,607,531.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0277
4.期末基金资产净值	2,307,338,829.99
5.期末基金份额净值	0.8406

注:1.本基金业績指不包括持有人认购或交易基金的各项費用, 计入財产后所剩收益水平将低于所列数字。

2. "本期已实现收益"指基本收益扣除费用后的余额, "本期利润"为本期已实现收益加上本期利润。

3. 所列数据截至2013年12月31日。

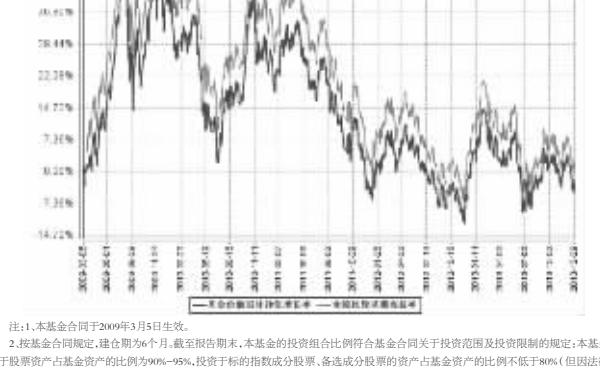
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长 ^①	净值增长标准差 ^②	业绩比较基准收益 ^③	业绩比较基准标准差 ^④	①-③	②-④
过去三个月	-3.26%	1.07%	-3.10%	1.07%	-0.16%	0.00%

3.2.2 本基金同期以来基金净值增长及其与同期业绩比较基准变动的比较

基金业績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如图



注:1. 本基金合同于2009年5月6日生效。

2. 按基金合同规定,建仓期6个月,截至报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定;本基金投资于股票类资产的占比为90%-95%,投资于债券的占比不超过5%,但因法律限制导致,本基金不能投资相关股票,而使得本基金不能达到95%的股票类资产的占比;本基金的股票类资产占基金资产的比例如下表所示,其中基金业者到目前为止在一年内的平均的股票类资产不低于基金资产净值的90%。

3.其他指标无。

4.1 管理人报告

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,本基金的 基金经理。	2011年5月25日	-	8

4.2 管理人报告中本基金运作合规情况的说明

本报告期内,本基金业者严格遵守《证券投资基金法》等有关法律、法规、规章和基金合同,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,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 为了公平对待所有投资人,保护各投资人利益,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》、《基金管理公司公平对待投资人管理办法(试点办法)》、《证券投资基金托管人公平交易制度指引(试点办法)》等法律法规和公司内部制度,制定了《公平交易制度(试点办法)》、《异常交易行为监控及报告办法》,对公司的各项资产的公平对待做出了明确的约定,并规定对买卖股票、债券时的价格涨跌幅偏离度、相关系数及交易时机选择进行监控,实现了公平交易;未出现不公平交易和利益输送的情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况 本基金业者严格遵守《证券投资基金法》等有关法律、法规和公司内部制度,制定了《公平交易制度(试点办法)》,对公司的各项资产的公平对待做出了明确的约定,并规定对买卖股票、债券时的价格涨跌幅偏离度、相关系数及交易时机选择进行监控,实现了公平交易;未出现不公平交易和利益输送的情况。

4.3.3 公平交易制度的执行情况 本基金业者严格遵守《证券投资基金法》等有关法律、法规和公司内部制度,制定了《公平交易制度(试点办法)》,对公司的各项资产的公平对待做出了明确的约定,并规定对买卖股票、债券时的价格涨跌幅偏离度、相关系数及交易时机选择进行监控,实现了公平交易;未出现不公平交易和利益输送的情况。

4.4 管理人报告中基金组合和运作分析

4.4.1 管理人报告中基金组合和运作分析

本基金业者根据指数型基金的特性,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行

为。

5.1 投资组合报告

5.1.1 期末基金资产组合情况

5.1.2 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组合

5.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

5.1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资

5.1.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资

5.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资

5.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.1.8 其他资产

5.1.9 合计

5.2 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组合

5.2.1 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组合

5.2.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资

5.2.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资

5.2.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资

5.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.2.7 其他

5.2.8 合计

5.3 主要财务指标和净值表现

5.3.1 本期主要财务指标

5.3.2 本期利润

5.3.3 加权平均基金份额本期利润

5.3.4 期末基金资产净值

5.3.5 期末基金份额净值

5.3.6 期末基金份额净值增长率

5.3.7 期末基金份额净值增长率标准差

5.3.8 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

5.3.9 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额标准差

5.3.10 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.11 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.12 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.13 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.14 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.15 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.16 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.17 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.18 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.19 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.20 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.21 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.22 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.23 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.24 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.25 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.26 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.27 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.28 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.29 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.30 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.31 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.32 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.33 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.34 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.35 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.36 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.37 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.38 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.39 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.40 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.41 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.42 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准差的比值

5.3.43 期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额与差额标准