

深证红利交易型开放式指数证券投资基金 二〇一二年年度报告摘要

2012 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

送出日期：二〇一三年三月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2013 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银深证红利 ETF
基金主代码	159905
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 5 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
报告期末基金份额总额	1,249,443,951.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 01 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的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票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常情况下，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 0.1%，偏离度年化标准差不超过 2%。
业绩比较基准	深证红利价格指数
风险收益特征	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。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	李芳菲
	联系电话	400-811-9999	010-66060069

	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年	2011 年	2010 年 11 月 5 日 (基金合同生效日)-2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-136,229,051.68	-43,672,732.00	343,950.80
本期利润	51,744,094.34	-464,653,629.50	2,122,032.77
加权平均基金份额本期利润	0.0398	-0.3683	0.0035
本期基金份额净值增长率	5.20%	-31.14%	0.35%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2731	-0.3090	0.0006
期末基金资产净值	908,256,639.57	938,725,576.34	609,565,983.77
期末基金份额净值	0.7269	0.6910	1.0035

注：1、所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、本基金基金合同生效日为 2010 年 11 月 05 日。

3.2 基金净值表现

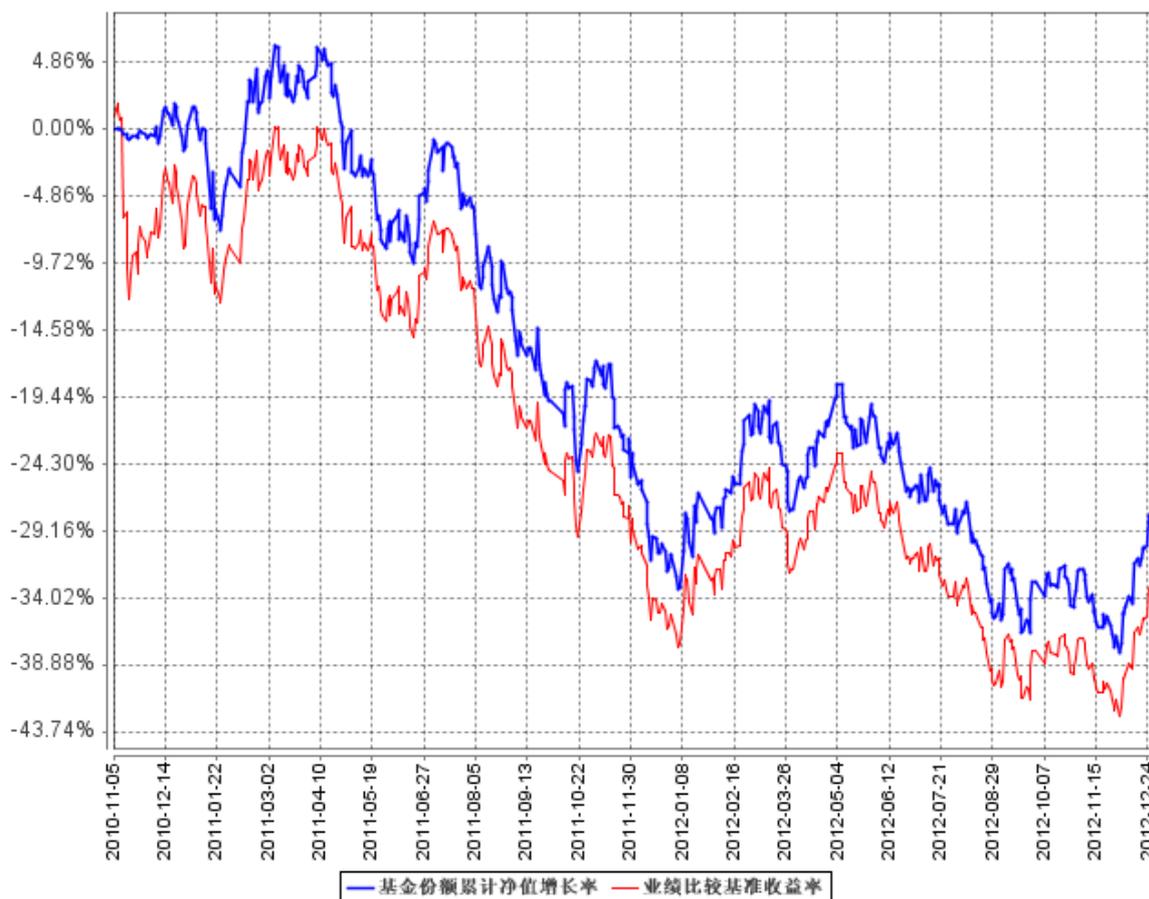
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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	8.27%	1.28%	8.44%	1.28%	-0.17%	0.00%
过去六个月	-1.53%	1.37%	-2.17%	1.37%	0.64%	0.00%
过去一年	5.20%	1.43%	4.00%	1.44%	1.20%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	-27.31%	1.36%	-32.63%	1.46%	5.32%	-0.10%

注：本基金合同生效日为 2010 年 11 月 5 日。

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

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



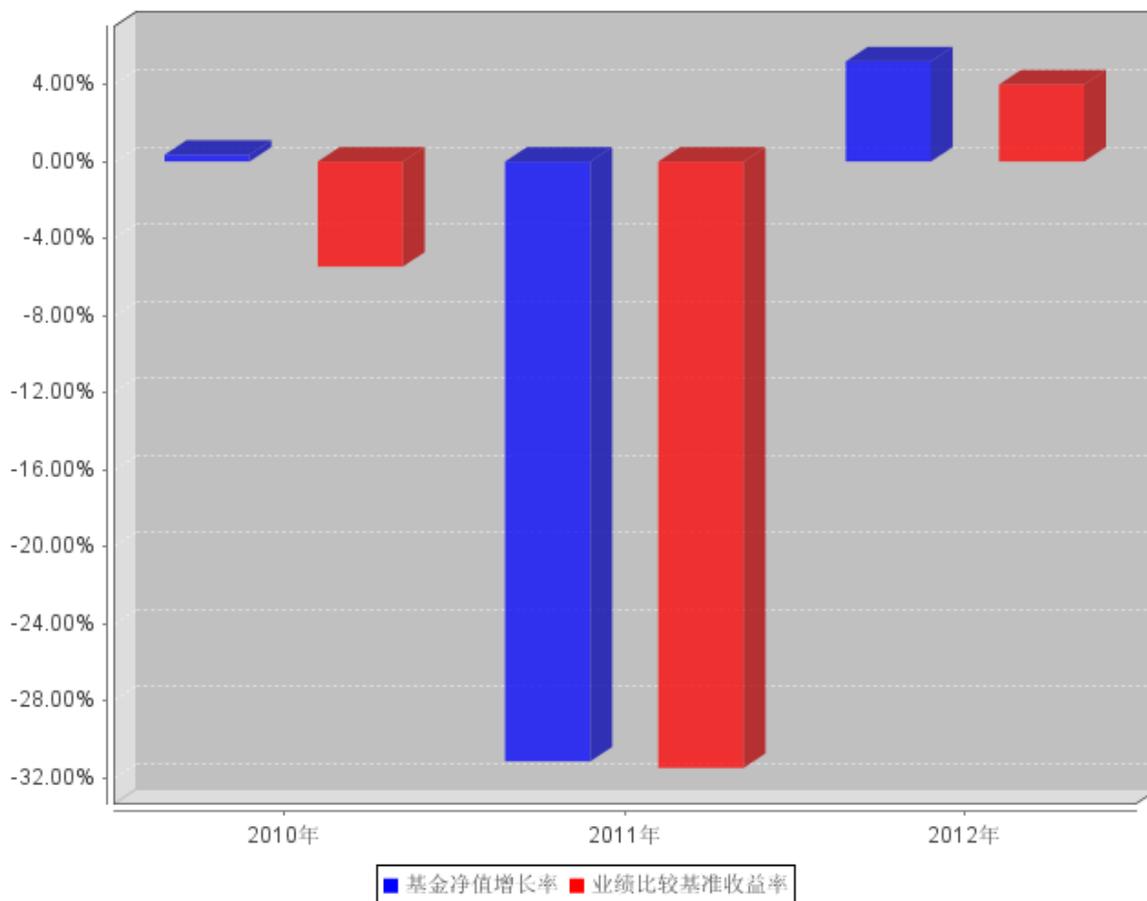
注：1、本基金基金合同于 2010 年 11 月 5 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 3 个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比

较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2010 年 11 月 5 日；

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日 2010 年 11 月 05 日至 2012 年末均未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2012 年 12 月 31 日，公司旗下管理 28 只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 1000 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江	指数投资部副总监，本基金的基金经理。	2011 年 5 月 25 日	-	7	先后在北京方速信融科技有限公司担任高级分析师，金诚信用评估有限公司担任分析师；2005 年加入工银瑞信，现任指数投资部副总监。曾任风险管理部投资风险管理业

					<p>务主管，2011 年 5 月 25 日至今担任工银 沪 深 300 基金、工银上证央企 ETF 基金、工银深证红利 ETF 基金、工银深证红利 ETF 联接基金的基金经理；2012 年 1 月 31 日至今担任工银 中 证 500 基金的基金经理；2012 年 10 月 25 日至今担任工银深证 100 指数投资基金的基金经理。</p>
赵栩	本基金基金经理	2012 年 10 月 9 日	-	4	<p>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</p>

					日至今担任工银深证红利ETF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。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期说明：

1) 何江的任职日期为公司执委会决议日期

2) 赵栩的任职日期为公司执委会决议日期

2、离任日期说明：无

3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4、本基金无基金经理助理

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，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2、适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、

企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、开放式基金。投资经理，指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

3、公平交易的具体措施

3.1 在研究和投资决策环节：

3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

3.1.2 各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行，在授权的范围内，独立、自主、审慎决策。

3.1.3 基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

3.1.4 对于涉及到关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。

3.2 在交易执行环节：

3.2.1 交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。

3.2.2 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施，保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

3.2.3 公平交易执行方法：

3.2.3.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确地执行。

3.2.3.2 在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于涉及到同一证券品种的交易执行，系统自动通过公平交易模块完成。

公平交易模块执行原理如下：

1) 同向交易指令：

a) 限价指令：交易员采用投资交易系统中的公平委托系统，按照各组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行；b) 市价指令：对于市价同向交易指令，交易员首先应该按照“时间优先”的原则执行交易指令，并在接到后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，交易员应采用投资交易系统中的公平委托模块，按照各基

金委托数量设置委托比例，按比例具体执行；c) 部分限价指令与部分市价指令：对于不同基金经理下达的不同类型的同向交易指令，交易员应该按照“价格优先”的原则执行交易指令，在市场价格未达到限价时，先执行市价指令、后执行限价指令；

2) 反向交易指令

a) 交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b) 根据证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关条款，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令；c) 同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d) 确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易，按要求投资组合经理要填写反向交易申请表，并要求相关投资经理提供决策依据，并保留记录备查。e) 以上反向交易要求完全按照指数的构成进行投资的组合等除外。

3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况，各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》，银行间市场债券买卖和回购交易，由交易员填写《银行间市场交易审批单》，经相关基金经理/投资经理、交易主管审批，并由交易员双人复核后方可执行。公司对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易，填写《大宗交易申请表》，经公司主管领导、法律合规部审批后执行。债券一级市场交易，填写《债券投标审批表》及《债券分销审批表》，经公司主管领导、法律合规部审批后执行。其他非集中竞价交易，参考上述审批流程执行。

3.2.5 对于非公开发行股票申购，各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》，独立确定申购价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司主管领导、法律合规部及其公司主管领导审核批准后执行。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，有关申购方案和分配方案应报公司主管领导、法律合规部，以保证分配结果符合公平交易的原则。

3.2.7 公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议，或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况，交易主管将具体情况报告公司主管领导，公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争

议内容进行协调处理。

3.3 公平交易的检查和价格监控

3.3.1 法律合规部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核，并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况，就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问，由基金/投资经理作出合理解释。

3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息，对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，如发现异常情况的，基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理解释。

3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理解释。风险管理部和法律合规部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理解释。

3.4 评估和分析

3.4.1 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，进行专项说明，提交法律合规部，法律合规部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

3.4.2 中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。法律合规部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内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%，应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。其中，中央交易室负责公平交易制度的披露，法律合规部负责公平交易控制方法的披露，风险管理部负责按本制度 3.4.1 条的规定对公平交易制度执行情况中当年度同向交易价差的专项分析。

4. 报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 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。

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.3.3 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%的情况有三次。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 管理人对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，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 0.52%。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

2012 年，本基金份额净值增长率为 5.20%，比较基准收益率为 4.00%。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

(1) 参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

(2) 各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金无可供分配收益，根据相关法律法规和本基金合同约定，本基金不进行收益分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管深证红利交易型开放式指数证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定，对深证红利交易型开放式指数证券投资基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在深证红利交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的深证红利交易型开放式指数证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本年度报告被出具了无保留意见的审计报告，且在审计报告中无强调事项，投资者欲了解详细内容，可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		4,995,869.57	2,448,701.19
结算备付金		78.86	102,783.70
存出保证金		750,000.00	500,000.00
交易性金融资产		904,189,646.86	937,301,094.16
其中：股票投资		904,189,646.86	937,301,094.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,029.59	606.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		909,936,624.88	940,353,185.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,859.18	19,469.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		361,104.98	414,665.66
应付托管费		72,221.00	82,933.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		795.69	12,687.37
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,231,004.46	1,097,854.14
负债合计		1,679,985.31	1,627,609.33
所有者权益：			
实收基金		1,249,443,951.00	1,358,443,951.00
未分配利润		-341,187,311.43	-419,718,374.66
所有者权益合计		908,256,639.57	938,725,576.34
负债和所有者权益总计		909,936,624.88	940,353,185.67

注：1、报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7269 元，基金份额总额 1,249,443,951.00 份；股票投资项含可退替代款估值增值。

2、基金合同生效日为 2010 年 11 月 5 日。

7.2 利润表

会计主体：深证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		58,602,529.89	-455,796,839.67
1.利息收入		32,272.95	372,492.58
其中：存款利息收入		32,272.95	192,924.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	179,567.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-129,421,285.62	-35,197,523.83
其中：股票投资收益		-147,500,114.82	-53,762,699.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		18,078,829.20	18,565,175.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		187,973,146.02	-420,980,897.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		18,396.54	9,089.08

列)			
减：二、费用		6,858,435.55	8,856,789.83
1. 管理人报酬		4,682,479.65	5,653,339.33
2. 托管费		936,495.99	1,130,667.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		500,697.66	1,293,624.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		738,762.25	779,157.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,744,094.34	-464,653,629.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,744,094.34	-464,653,629.50

注：基金合同生效日为 2010 年 11 月 5 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,358,443,951.00	-419,718,374.66	938,725,576.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	51,744,094.34	51,744,094.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-109,000,000.00	26,786,968.89	-82,213,031.11
其中：1. 基金申购款	180,000,000.00	-50,090,397.77	129,909,602.23
2. 基金赎回款	-289,000,000.00	76,877,366.66	-212,122,633.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,249,443,951.00	-341,187,311.43	908,256,639.57

项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	607,443,951.00	2,122,032.77	609,565,983.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-464,653,629.50	-464,653,629.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	751,000,000.00	42,813,222.07	793,813,222.07
其中：1. 基金申购款	1,601,500,000.00	25,534,014.10	1,627,034,014.10
2. 基金赎回款	-850,500,000.00	17,279,207.97	-833,220,792.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,358,443,951.00	-419,718,374.66	938,725,576.34

注：基金合同生效日为 2010 年 11 月 5 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>毕万英</u>	<u>朱辉毅</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

深证红利交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 808 号《关于核准深证红利交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 607,395,982.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 275 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 607,443,951.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 47,969.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管

人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深圳上[2011]1 号文核准同意,本基金于 2011 年 1 月 11 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益;本基金的投资范围为主要投资于标的指数成分股票、备选成分股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成分股票及备选成分股票的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为:深证红利价格指数。

本基金的基金管理人工银瑞信管理有限公司以本基金为目标 Exchange-Traded Fund(以下简称 ETF),募集成立了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(以下简称“工银深证红利 ETF 联接基金”)。工银深证红利 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人控股股东
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	基金管理人管理的其他基金
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,682,479.65	5,653,339.33
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	936,495.99	1,130,667.85

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
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	1,182,100,191.00	94.61%	1,276,629,877.00	93.98%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,995,869.57	29,647.63	2,448,701.19	172,113.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与上述各关联方及托管人股东承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
000002	万	2012	重大	10.12	2013	11.13	16,299,327	134,961,216.38	164,949,189.24	-

	科 A	年 12 月 26 日	事项		年 1 月 21 日					
000527	美的电器	2012 年 8 月 27 日	重大事项	9.18	-	-	3,746,640	65,090,754.07	34,394,155.20	-

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2012 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 129,909,602.23 元，其中包括以股票支付的申购款 125,840,166.12 元和以现金返还的申购款 4,069,436.11 元(2011 年度：总额为 1,627,034,014.10 元，其中包括以股票支付的申购款 1,510,765,769.45 元和以现金返还的申购款 116,268,244.65 元)。

(2) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为 704,846,302.42 元, 属于第二层级的余额为 199,343,344.44 元, 无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日: 第一层级 937,301,094.16 元, 无第二层级, 无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	904,189,646.86	99.37
	其中: 股票	904,189,646.86	99.37
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,995,948.43	0.55
6	其他各项资产	751,029.59	0.08
7	合计	909,936,624.88	100.00

注: 1、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;

2、股票投资项含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	80,498,775.51	8.86
C	制造业	476,134,951.92	52.42
C0	食品、饮料	91,269,792.40	10.05
C1	纺织、服装、皮毛	5,728,687.00	0.63
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	62,267,333.33	6.86
C7	机械、设备、仪表	305,097,368.79	33.59
C8	医药、生物制品	11,771,770.40	1.30
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,135,856.00	0.90
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	14,100,550.56	1.55
G	信息技术业	5,301,105.00	0.58
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	89,754,637.17	9.88
J	房地产业	213,883,691.34	23.55
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	16,380,079.36	1.80
	合计	904,189,646.86	99.55

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

2、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。

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	16,299,327	164,949,189.24	18.16

2	000651	格力电器	4,259,748	108,623,574.00	11.96
3	000157	中联重科	7,739,866	71,284,165.86	7.85
4	000568	泸州老窖	1,315,869	46,581,762.60	5.13
5	000983	西山煤电	2,910,500	40,485,055.00	4.46
6	000895	双汇发展	594,542	34,423,981.80	3.79
7	000527	美的电器	3,746,640	34,394,155.20	3.79
8	000402	金融街	4,504,950	30,408,412.50	3.35
9	000783	长江证券	2,954,816	27,775,270.40	3.06
10	002142	宁波银行	2,327,200	24,807,952.00	2.73

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

8.3.2 积极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

无。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	92,833,398.55	9.89
2	000425	徐工机械	30,752,958.04	3.28
3	000540	中天城投	10,348,066.55	1.10
4	000046	泛海建设	9,966,039.09	1.06
5	000527	美的电器	4,747,856.00	0.51
6	002202	金风科技	4,318,927.90	0.46
7	002242	九阳股份	3,853,349.47	0.41
8	000528	柳工	2,979,674.65	0.32
9	000063	中兴通讯	2,168,236.98	0.23
10	000006	深振业 A	1,528,550.30	0.16
11	000157	中联重科	1,499,482.87	0.16
12	000002	万科 A	1,407,735.01	0.15
13	002142	宁波银行	1,169,112.00	0.12
14	000568	泸州老窖	773,150.30	0.08
15	000728	国元证券	575,876.88	0.06
16	002128	露天煤业	536,929.90	0.06
17	000869	张裕 A	452,977.00	0.05

18	000983	西山煤电	452,366.00	0.05
19	000402	金融街	284,841.00	0.03
20	000895	双汇发展	279,293.80	0.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	53,474,258.82	5.70
2	000060	中金岭南	23,037,703.31	2.45
3	000709	河北钢铁	21,912,613.73	2.33
4	000690	宝新能源	10,996,475.28	1.17
5	000027	深圳能源	10,259,713.39	1.09
6	000002	万科A	7,699,441.23	0.82
7	000157	中联重科	3,753,816.82	0.40
8	000568	泸州老窖	3,236,227.04	0.34
9	000895	双汇发展	2,644,425.98	0.28
10	000983	西山煤电	2,471,094.17	0.26
11	000006	深振业A	2,272,752.93	0.24
12	000527	美的电器	2,028,573.55	0.22
13	000783	长江证券	1,628,958.84	0.17
14	000402	金融街	1,563,811.36	0.17
15	002202	金风科技	1,412,300.00	0.15
16	000039	中集集团	1,122,294.79	0.12
17	000937	冀中能源	1,081,114.00	0.12
18	000933	神火股份	932,078.21	0.10
19	000800	一汽轿车	926,691.01	0.10
20	000562	宏源证券	909,992.99	0.10

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	173,592,391.76
卖出股票收入（成交）总额	163,550,914.38

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,029.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	751,029.59

8.9.4 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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	164,949,189.24	18.16	重大事项
2	000527	美的电器	34,394,155.20	3.79	重大事项

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前五名股票中未存在流通受限情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,606	777,985.03	1,189,895,085.00	95.23%	59,548,866.00	4.77%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例
农行-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	1,182,100,191.00	94.61%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国宋庆龄基金会	5,000,150.00	0.40%
2	程显珍	2,000,200.00	0.16%
3	中信证券股份有限公司	1,471,113.00	0.12%
4	李志研	1,365,300.00	0.11%
5	黄玉莊	1,312,860.00	0.11%
6	董伟玲	1,000,090.00	0.08%
7	武汉市铭源投资有限公司	1,000,030.00	0.08%
8	郑静雪	800,048.00	0.06%
9	翟平	600,054.00	0.05%
10	张波	600,017.00	0.05%

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金管理人的从业人员在本报告期末未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年11月5日）基金份额总额	607,443,951.00
本报告期期初基金份额总额	1,358,443,951.00
本报告期基金总申购份额	180,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	289,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,249,443,951.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2013 年 2 月 2 日，基金管理人发布了《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第三届董事会十五次会议审议并通过，夏洪彬先生不再担任副总经理职务，副总经理职务由毕万英先生担任。

2、基金托管人：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所审计费用玖万柒仟元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
西南证券	1	323,176,372.26	95.86%	273,936.24	96.02%	-
国信证券	1	13,966,933.88	4.14%	11,348.36	3.98%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2、券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。