深证红利交易型开放式指数证券投资基金
2015 年半年度报告

2015 年 6 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十八日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§1 重要提示及目录

1.1 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。本半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 2015 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 33
7.1 期末基金资产组合情况 33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 37
7.6 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 37
7.7 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 37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 37
7.9 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 38

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 38
7.12 投资组合报告附注 38
§8 基金份额持有人信息 39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 39
8.2 期末上市基金前十名持有人 39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 40
§9 开放式基金份额变动 40
§10 重大事件揭示 41
10.1 基金份额持有人大会决议 41
10.2 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 41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 41
10.4 基金投资策略的改变 41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 41
10.8 其他重大事件 43
§11 影响投资者决策的其他重要信息 44
§12 备查文件目录 44
12.1 备查文件目录 44
12.2 存放地点 44
12.3 查阅方式 44

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银深证红利 ETF
场内简称	深红利
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	258,943,951.00 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	2011-01-11

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。
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	林葛
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街丙 17 号北	北京东城区建国门内大街 69

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	京银行大厦	号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	100033	100031
法定代表人	郭特华	刘士余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	358,065,606.63
本期利润	170,970,699.30
加权平均基金份额本期利润	0.3188
本期加权平均净值利润率	26.67%
本期基金份额净值增长率	29.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	101,129,242.03
期末可供分配基金份额利润	0.3905
期末基金资产净值	360,073,193.03
期末基金份额净值	1.3905
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.05%

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；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

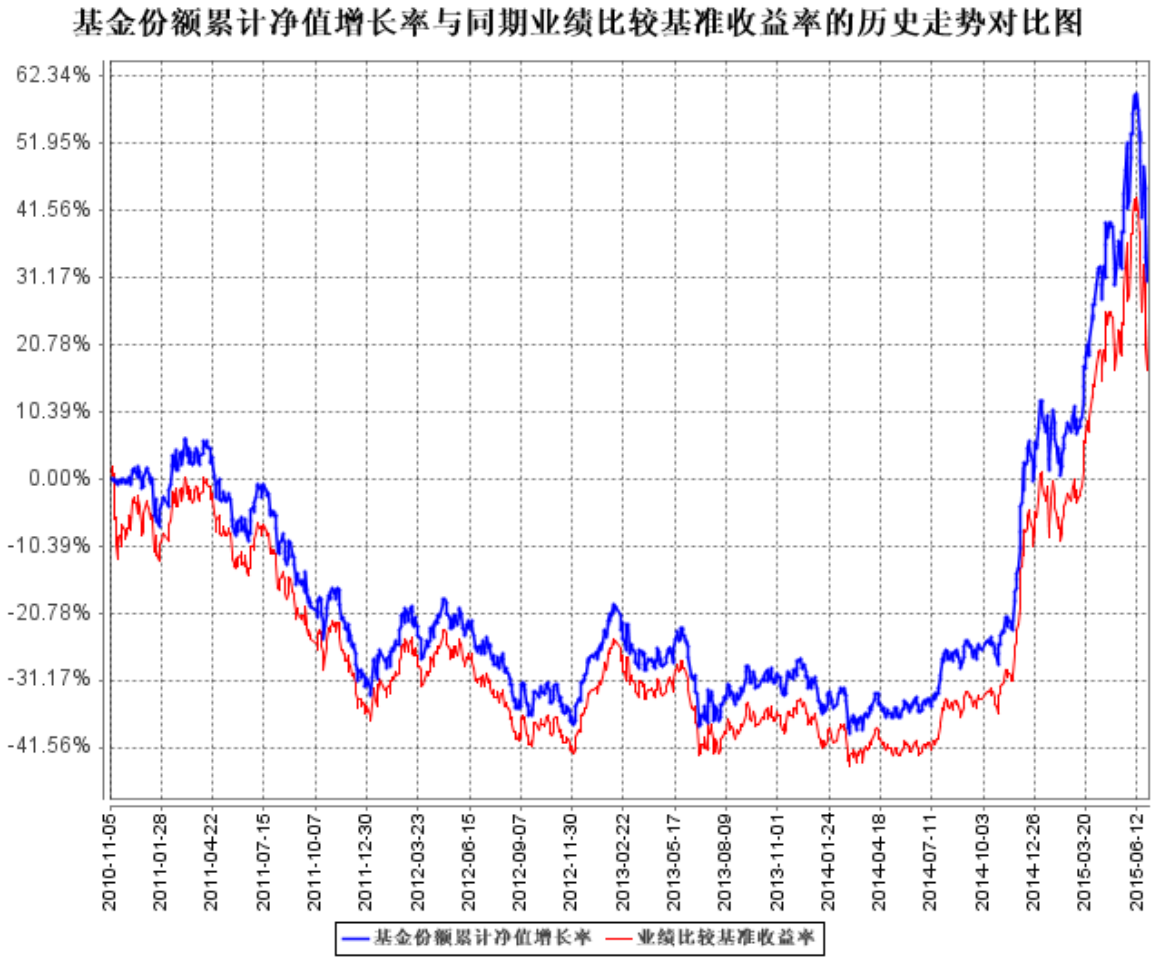
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-2.78%	3.29%	-2.88%	3.37%	0.10%	-0.08%
过去三个月	11.46%	2.54%	10.88%	2.59%	0.58%	-0.05%
过去六个月	29.04%	2.24%	28.67%	2.28%	0.37%	-0.04%
过去一年	111.74%	1.87%	111.73%	1.90%	0.01%	-0.03%
过去三年	88.36%	1.56%	81.13%	1.58%	7.23%	-0.02%
自基金合同生效起至今	39.05%	1.49%	24.74%	1.55%	14.31%	-0.06%

注：1、本基金的业绩比较基准为：深证红利价格指数；

2、本基金合同生效日为 2010 年 11 月 5 日。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 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%。

3.3 其他指标

无。

§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、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 66 只公募基金——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、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金、工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老产业股票型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金、工银瑞信互联网加

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

股票型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、工银瑞信聚焦 30 股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 3500 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		
赵栩	本基金的基金经理	2012 年 10 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 联接基金基金经理，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。

注：

1、任职日期说明：赵栩的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2、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》的相关规定等。

3、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，无损害基金份额持有人利益的行为。

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；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 4 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 0.03%，偏离度年化标准差为 0.82%。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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 29.04%，业绩比较基准增长率为 28.67%。

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，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§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

在托管本基金的过程中，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》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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本基金的投资运作、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 托管人对本半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本基金半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	9,273,827.03	5,441,131.64
结算备付金		6,789,850.50	111,111.92
存出保证金		10,282.18	7,902.73
交易性金融资产	6.4.7.2	351,349,205.60	855,686,026.20

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

其中：股票投资		351,349,205.60	855,686,026.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,387.06	1,629.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		367,425,552.37	861,247,802.15
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 6 月 30 日**	**上年度末 2014 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,065,603.63	182,618.25
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		171,116.64	376,678.31
应付托管费		34,223.34	75,335.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	57,400.27	25,152.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	4,024,015.46	177,564.18
负债合计		7,352,359.34	837,348.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	258,943,951.00	798,443,951.00
未分配利润	6.4.7.10	101,129,242.03	61,966,502.36
所有者权益合计		360,073,193.03	860,410,453.36
负债和所有者权益总计		367,425,552.37	861,247,802.15

注：1、报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3905 元，基金份额总额 258,943,951.00 份；股票投资项含可退替代款估值增值。

2、本基金基金合同生效日为 2010 年 11 月 05 日。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		173,442,729.83	-41,237,084.26
1.利息收入		26,748.04	28,122.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,748.04	28,122.13
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		360,641,496.23	-54,392,335.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	357,121,835.88	-70,018,402.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,519,660.35	15,626,067.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-187,094,907.33	13,108,111.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-130,607.11	19,017.68
减：二、费用		2,472,030.53	2,525,971.28
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,602,469.85	1,665,523.53
2．托管费	6.4.10.2.2	320,493.94	333,104.71
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	217,383.25	200,536.41
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	331,683.49	326,806.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		170,970,699.30	-43,763,055.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		170,970,699.30	-43,763,055.54

注：本基金基金合同生效日为 2010 年 11 月 05 日。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	798,443,951.00	61,966,502.36	860,410,453.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	170,970,699.30	170,970,699.30
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）	-539,500,000.00	-131,807,959.63	-671,307,959.63
其中：1.基金申购款	2,045,000,000.00	623,412,798.81	2,668,412,798.81
2.基金赎回款	-2,584,500,000.00	-755,220,758.44	-3,339,720,758.44
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）	258,943,951.00	101,129,242.03	360,073,193.03
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	1,146,943,951.00	-351,195,513.16	795,748,437.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-43,763,055.54	-43,763,055.54
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）	-165,500,000.00	58,052,272.86	-107,447,727.14
其中：1.基金申购款	72,000,000.00	-26,378,500.06	45,621,499.94
2.基金赎回款	-237,500,000.00	84,430,772.92	-153,069,227.08
四、本期向基金份额持有	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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）	981,443,951.00	-336,906,295.84	644,537,655.16

注：本基金基金合同生效日为 2010 年 11 月 05 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

郭特华	郭特华	朱辉毅
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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。

6.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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。

6.4.3 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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与最近一期年度报告相一致。会计估计变更请详见 6.4.5.2 的说明。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》通知的规定，本报告期本基金对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)改为采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。具体参见我司于 2015 年 3 月 27 日发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，应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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	9,273,827.03
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,273,827.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	335,473,193.14	351,349,205.60	15,876,012.46
贵金属投资-金交所	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

黄金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		335,473,193.14	351,349,205.60	15,876,012.46

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无期末余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,231.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,151.39
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.60
合计	2,387.06

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	57,400.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	57,400.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提信息披露费	148,765.71
预提上市费	29,752.78
预提审计费	44,630.98
预提指数使用费	50,000.00
应付替代款	3,331,981.51
可退替代款	418,884.48
合计	4,024,015.46

注：1、可退替代款是指投资者采用可以用现金替代方式申购本基金时，在基金补足被替代股票（或采取强制退款）之前，该股票的实际替代金额与申购日估值的差额；

2、应付替代款是指投资者采用可以用现金替代方式申购本基金时，在基金补足被替代股票（或采取强制退款）之后，以该股票的替代金额与买入成本的差额确定应退还给投资者或应由投资者补缴的现金替代款。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	798,443,951.00	798,443,951.00
本期申购	2,045,000,000.00	2,045,000,000.00
本期赎回(以"-"号填列)	-2,584,500,000.00	-2,584,500,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	258,943,951.00	258,943,951.00

注：“本期申购”中包含红利再投、转换入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-170,300,893.21	232,267,395.57	61,966,502.36
本期利润	358,065,606.63	-187,094,907.33	170,970,699.30
本期基金份额交易产生的变动数	-35,732,670.43	-96,075,289.20	-131,807,959.63
其中：基金申购款	636,132,645.66	-12,719,846.85	623,412,798.81
基金赎回款	-671,865,316.09	-83,355,442.35	-755,220,758.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	152,032,042.99	-50,902,800.96	101,129,242.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,735.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,921.30
其他	90.79
合计	26,748.04

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	49,209,751.05
股票投资收益——赎回差价收入	307,912,084.83
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	357,121,835.88

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	138,724,034.42

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

减：卖出股票成本总额	89,514,283.37
买卖股票差价收入	49,209,751.05

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	3,339,720,758.44
减：现金支付赎回款总额	312,535,015.44
减：赎回股票成本总额	2,719,273,658.17
赎回差价收入	307,912,084.83

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间无申购差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期间无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,519,660.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,519,660.35

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-187,136,641.81
——股票投资	-187,136,641.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	41,734.48
合计	-187,094,907.33

注：“其他”为可退替代款公允价值变动损益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-130,607.11
合计	-130,607.11

注：替代损益指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	217,383.25
银行间市场交易费用	-
合计	217,383.25

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
指数使用费	108,314.02
上市年费	29,752.78
银行费用	220.00
合计	331,683.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,602,469.85	1,665,523.53
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	320,493.94	333,104.71

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	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	179,641,792.00	69.37%	689,166,792.00	86.31%

6.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	9,273,827.03	22,735.95	12,129,008.28	27,922.64

注：1、本半年度末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

2、上年度可比期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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
000778	新兴铸管	2015 年 6 月	重大事项	12.96	-	-	745,180	5,455,113.87	9,657,532.80	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

		15 日								
002269	美邦服饰	2015 年 5 月 22 日	重大事项	11.86	2015 年 7 月 2 日	10.67	383,945	2,007,143.54	4,553,587.70	-
000539	粤电力 A	2015 年 6 月 8 日	重大事项	11.94	2015 年 7 月 21 日	10.75	308,820	2,157,410.01	3,687,310.80	-
002001	新和成	2015 年 6 月 30 日	重大事项	17.09	2015 年 7 月 13 日	18.49	172,134	3,561,995.75	2,941,770.06	-
002242	九阳股份	2015 年 6 月 15 日	重大事项	19.45	2015 年 7 月 7 日	17.51	94,934	1,445,912.81	1,846,466.30	-
000022	深赤湾 A	2015 年 4 月 23 日	重大事项	26.69	-	-	49,968	1,044,318.79	1,333,645.92	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成分股不受此限；本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成分股不受此限。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2014 年 12 月 31 日和 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2014 年 12 月 31 日和 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

银行存款	9,273,827.03	-	-	-	-	-	9,273,827.03
结算备付金	6,789,850.50	-	-	-	-	-	6,789,850.50
存出保证金	10,282.18	-	-	-	-	-	10,282.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	351,349,205.60	351,349,205.60
应收利息	-	-	-	-	-	2,387.06	2,387.06
资产总计	16,073,959.71	-	-	-	-	351,351,592.66	367,425,552.37
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,065,603.63	3,065,603.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	171,116.64	171,116.64
应付托管费	-	-	-	-	-	34,223.34	34,223.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	57,400.27	57,400.27
其他负债	-	-	-	-	-	4,024,015.46	4,024,015.46
负债总计	-	-	-	-	-	7,352,359.34	7,352,359.34
利率敏感度缺口	16,073,959.71	-	-	-	-	343,999,233.32	360,073,193.03
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,441,131.64	-	-	-	-	-	5,441,131.64
结算备付金	111,111.92	-	-	-	-	-	111,111.92
存出保证金	7,902.73	-	-	-	-	-	7,902.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	855,686,026.20	855,686,026.20
应收利息	-	-	-	-	-	1,629.66	1,629.66
资产总计	5,560,146.29	-	-	-	-	855,687,655.86	861,247,802.15
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	182,618.25	182,618.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	376,678.31	376,678.31
应付托管费	-	-	-	-	-	75,335.65	75,335.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,152.40	25,152.40
其他负债	-	-	-	-	-	177,564.18	177,564.18
负债总计	-	-	-	-	-	837,348.79	837,348.79
利率敏感度缺口	5,560,146.29	-	-	-	-	854,850,307.07	860,410,453.36

注：1. 表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类；

2. 股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指数型证券投资基金，于 2014 年 12 月 31 日和 2015 年 6 月 30 日，未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	351,349,205.60	97.58	855,686,026.20	99.45
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	351,349,205.60	97.58	855,686,026.20	99.45

注：1、本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、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。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。其中，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%。

2、股票投资项包含可退替代款估值增值。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	2、用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	3、Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准增加 5%	17,690,071.97	42,448,591.26
	业绩比较基准减少 5%	-17,690,071.97	-42,448,591.26

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	351,349,205.60	95.62
	其中：股票	351,349,205.60	95.62
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	-	-
	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	16,063,677.53	4.37
7	其他各项资产	12,669.24	0.00
8	合计	367,425,552.37	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

B	采矿业	4,403,419.86	1.22
C	制造业	197,471,889.00	54.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,687,310.80	1.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,509,082.56	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	72,890,211.53	20.24
K	房地产业	65,452,315.37	18.18
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	2,893,242.00	0.80
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	-	-
	合计	351,307,471.12	97.57

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。

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

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	000651	格力电器	769,691	49,183,254.90	13.66
2	000002	万　科A	2,862,946	41,569,975.92	11.54
3	000333	美的集团	691,221	25,768,718.88	7.16
4	000776	广发证券	975,235	22,089,072.75	6.13
5	000166	申万宏源	1,203,641	19,559,166.25	5.43
6	000783	长江证券	1,165,030	16,252,168.50	4.51
7	000100	TCL 集团	2,561,000	14,469,650.00	4.02
8	000157	中联重科	1,390,232	11,274,781.52	3.13

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

9	000778	新兴铸管	745,180	9,657,532.80	2.68
10	000039	中集集团	293,645	9,484,733.50	2.63
11	000559	万向钱潮	403,038	8,810,410.68	2.45
12	002142	宁波银行	415,709	8,792,245.35	2.44
13	000402	金 融 街	595,308	8,411,702.04	2.34
14	002008	大族激光	281,002	8,070,377.44	2.24
15	000568	泸州老窖	241,259	7,867,455.99	2.18
16	000540	中天城投	589,492	7,427,599.20	2.06
17	000425	徐工机械	522,939	6,939,400.53	1.93
18	000895	双汇发展	314,879	6,716,369.07	1.87
19	000001	平安银行	426,242	6,197,558.68	1.72
20	000581	威孚高科	183,203	5,677,460.97	1.58
21	002269	美邦服饰	383,945	4,553,587.70	1.26
22	000012	南 玻A	337,919	4,507,839.46	1.25
23	000046	泛海控股	302,439	4,430,731.35	1.23
24	000858	五 粮 液	119,400	3,784,980.00	1.05
25	000539	粤电力A	308,820	3,687,310.80	1.02
26	000006	深振业A	266,198	3,612,306.86	1.00
27	000088	盐 田 港	224,254	3,175,436.64	0.88
28	000528	柳 工	261,017	3,085,220.94	0.86
29	002001	新 和 成	172,134	2,941,770.06	0.82
30	000069	华侨城A	222,900	2,893,242.00	0.80
31	000541	佛山照明	238,224	2,732,429.28	0.76
32	000937	冀中能源	327,929	2,629,990.58	0.73
33	002399	海普瑞	71,549	2,431,950.51	0.68
34	000550	江铃汽车	58,870	2,160,529.00	0.60
35	000726	鲁 泰A	142,600	1,982,140.00	0.55
36	002304	洋河股份	27,400	1,900,464.00	0.53
37	002242	九阳股份	94,934	1,846,466.30	0.51
38	002128	露天煤业	107,611	1,773,429.28	0.49
39	000869	张 裕A	33,293	1,624,365.47	0.45
40	000022	深赤湾A	49,968	1,333,645.92	0.37

7.3.2 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所有股票投资明细

无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000333	美的集团	7,025,297.22	0.82
2	000540	中天城投	6,465,434.18	0.75
3	000425	徐工机械	6,305,042.46	0.73
4	000001	平安银行	5,806,468.62	0.67
5	000858	五 粮 液	3,468,570.00	0.40
6	000039	中集集团	2,984,088.07	0.35
7	002142	宁波银行	2,918,111.23	0.34
8	000069	华侨城Ａ	2,680,509.00	0.31
9	000651	格力电器	2,160,379.00	0.25
10	000559	万向钱潮	2,053,694.90	0.24
11	000021	深科技	2,041,551.10	0.24
12	002304	洋河股份	1,780,998.00	0.21
13	000046	泛海控股	1,756,234.00	0.20
14	000002	万　科Ａ	1,634,101.40	0.19
15	000568	泸州老窖	1,526,753.25	0.18
16	000006	深振业Ａ	1,447,582.60	0.17
17	002269	美邦服饰	1,274,622.00	0.15
18	000541	佛山照明	1,211,017.10	0.14
19	000581	威孚高科	1,154,406.00	0.13
20	000869	张　裕Ａ	1,150,230.00	0.13

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。

7.4.2 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	000166	申万宏源	11,309,875.00	1.31
2	000825	太钢不锈	5,433,739.04	0.63
3	000783	长江证券	5,287,782.00	0.61
4	000021	深科技	4,697,965.24	0.55

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

5	002236	大华股份	4,444,010.16	0.52
6	000402	金 融 街	4,421,229.00	0.51
7	000012	南 玻Ａ	3,894,567.55	0.45
8	000540	中天城投	3,655,117.78	0.42
9	000333	美的集团	3,645,451.57	0.42
10	000002	万 科Ａ	3,616,046.21	0.42
11	000651	格力电器	3,093,697.20	0.36
12	000776	广发证券	2,680,762.00	0.31
13	000900	现代投资	2,483,411.70	0.29
14	000157	中联重科	2,018,756.20	0.23
15	002399	海普瑞	1,468,744.44	0.17
16	000425	徐工机械	1,157,285.74	0.13
17	000100	TCL 集团	1,133,063.00	0.13
18	000895	双汇发展	981,277.00	0.11
19	002008	大族激光	921,077.00	0.11
20	000046	泛海控股	847,573.43	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。

7.4.3 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	131,127,183.90
卖出股票收入（成交）总额	138,724,034.42

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	10,282.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,387.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,669.24

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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	000778	新兴铸管	9,657,532.80	2.68	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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
756	342,518.45	244,666,507.00	94.49%	14,277,444.00	5.51%

8.1.2 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	179,641,792.00	69.37%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1	信诚人寿保险有限公司	61,341,658.00	23.69%
2	黄玉莊	1,862,660.00	0.72%
3	中国银河证券股份有限公司	1,851,003.00	0.71%
4	方正证券股份有限公司	1,744,354.00	0.67%
5	罗晶喜	423,000.00	0.16%
6	董伟玲	399,790.00	0.15%
7	周碧瑜	302,530.00	0.12%
8	曹希杰	300,009.00	0.12%
9	裴慧峰	260,002.00	0.10%
10	刘治建	201,600.00	0.08%

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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 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	798,443,951.00
本报告期基金总申购份额	2,045,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	2,584,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	258,943,951.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

毕万英先生于 2015 年 4 月 26 日离任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，公司于 2015 年 4 月 28 日对外披露；库三七先生于 2015 年 5 月 29 日离任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，公司于 2015 年 6 月 2 日对外披露。

2、基金托管人托管部门：

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或行政处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

西南证券	1	142,389,971.60	100.00%	126,001.41	100.00%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	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、个股分析的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。

10.7.2 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	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	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

注：无

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于深证红利交易型开放式指数证券投资基金暂停申购赎回业务的公告	三大报、公司网站	2015 年 1 月 26 日
2	关于深证红利交易型开放式指数证券投资基金恢复申购赎回业务的公告	三大报、公司网站	2015 年 1 月 27 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 14 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于基金直销电子自助交易业务开通中国银行和交通银行支付方式及部分费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 28 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 5 月 12 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 5 月 28 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 6 月 2 日

注：三大报包括中国证券报、上海证券报、证券时报。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 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设立的文件

2、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站