

工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

重要提示 本基金经中国证监会2012年12月20日证监许可【2012】204号文核准募集。本基金合同于2012年4月26日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明其对该基金的风险和收益作出实质性判断或保证。

3. 投资组合构建 基金投资组合决策委员会的决议,采用数量管理系统,选择证券构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合管理。

一、基金管理人概况 1. 基金管理人基本情况 名称:工银瑞信基金管理有限公司 住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-02层

办公地址:深圳市福田区福中三路1012号国信证券大厦十六层至十六层 法定代表人:李勇 总经理:张光华

(50) 国信证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路1012号国信证券大厦十六层至十六层 法定代表人:李勇

基金业绩比较基准:中证800指数收益率*20%+上证国债指数收益率*80% 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

二、基金托管人概况 1. 基金托管人基本情况 名称:中国银行股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街2号

(51) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

(52) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

三、基金募集概况 1. 基金募集情况 本基金经中国证监会2012年12月20日证监许可【2012】204号文核准募集。本基金合同于2012年4月26日正式生效。

(53) 华泰证券股份有限公司 注册地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李勇

(54) 中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

四、基金的投资目标 本基金主要投资于基本面量化策略股票,追求基金资产的长期增值。

(55) 兴业证券股份有限公司 注册地址:福州市湖东路268号 法定代表人:李勇

(56) 广发证券股份有限公司 注册地址:广州市天河区马场路26号 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

五、基金的投资策略 1. 资产配置策略 本基金采用定量方法进行资产配置,根据市场环境调整股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等资产的比例。

(57) 安信证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区金田路4038号安信证券大厦 法定代表人:李勇

(58) 方正证券股份有限公司 注册地址:吉林省长春市净月大街6666号 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

六、基金的风险控制 1. 风险控制目标 本基金通过严格的风险控制措施,追求基金资产的长期增值,并控制投资风险。

(59) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

(60) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

七、基金的费用 1. 基金管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。

(61) 华泰证券股份有限公司 注册地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李勇

(62) 中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

八、基金的投资业绩 1. 业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证800指数收益率*20%+上证国债指数收益率*80%。

(63) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

(64) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

九、基金的投资范围 1. 股票投资 本基金主要投资于基本面量化策略股票,追求基金资产的长期增值。

(65) 华泰证券股份有限公司 注册地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李勇

(66) 中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十、基金的投资组合 1. 投资组合报告 截至2015年6月30日,本基金投资组合如下:

(67) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

(68) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十一、基金的投资业绩 1. 业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证800指数收益率*20%+上证国债指数收益率*80%。

(69) 华泰证券股份有限公司 注册地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李勇

(70) 中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十二、基金的投资范围 1. 股票投资 本基金主要投资于基本面量化策略股票,追求基金资产的长期增值。

(71) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

(72) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十三、基金的投资组合 1. 投资组合报告 截至2015年6月30日,本基金投资组合如下:

(73) 华泰证券股份有限公司 注册地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李勇

(74) 中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十四、基金的投资业绩 1. 业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证800指数收益率*20%+上证国债指数收益率*80%。

(75) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

(76) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十五、基金的投资范围 1. 股票投资 本基金主要投资于基本面量化策略股票,追求基金资产的长期增值。

(77) 华泰证券股份有限公司 注册地址:南京市江东中路228号 法定代表人:李勇

(78) 中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十六、基金的投资组合 1. 投资组合报告 截至2015年6月30日,本基金投资组合如下:

(79) 光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区威海路723号光大证券大厦10楼 法定代表人:李勇

(80) 招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区福中三路招商证券大厦401-410层 法定代表人:李勇

基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股指期货、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货等。