基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

工银瑞信货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

确性和完整性 基金托管人	的董事会及董事(承担个别及连带) 中国建设银行股(设告等内容,保证	责任。 分有限公司村	艮据本基	金合同规定,	于2016年1月18	日复核		
基金的过往。本报告中财金	承诺以诚实信用、 业绩并不代表其。 各资料未经审计。 1015年10月1日起	未来表现。投	资有风					的招募说明书。
			§ 2	基金产品概念	兄			
基金简称				工银货币				
交易代码				482002				
基金运作方式				契约型开放式				
基金合同生效日				2006年3月20日				
报告期末基金份额总	部			196,626,552,299	9.19(5)			
投资目标				力求保证基金	资产安全和良好流动	性的前提	下,获得超过业	绩比较基准的收益。
投资策略				在确定的利率 来获取稳定的	策略和期限结构、类 收益。	属配置策略	8下,通过短期份	市市场工具的投资
业绩比较基准				税后6个月银行 款利率。	f定期储蓄存款利率	即(1-利	息税率)×6个	月银行定期储蓄存
风险收益特征			本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。 在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般情券基金,也低于混合型基金与股票型基金。					
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	中国建设银行股份有限公司			
3.1 主要财务	·指标	3,5	工女州	务指标和基金	期(2015年10月1日	2017/E	ia Pauli	单位:人民币
土安約カ18か 1. 本期円3	i-mini- of			1815	別(2015年10月1日	- 20154	12月31日 /	1.515.298.161.13
 本期利润 	A-FREEX SEE							1,515,298,161.1.
 平 明 刊 明 期 末 基 金 资 产 净 	A4-							1,515,298,161.1.
(2)所列数技 (3)上述基金 (4)本期已		2月31日。 括持有人认则 本期利息收 1上本期公允 1本期利润的	勾或交易 人、投资 价值变 金额相	收益、其他收 动收益,由于1 等。	人(不含公允(货币市场基金系	↑值变云	收益) 扣除	相关费用后的
动收益为零,本 3.2 基金净值	ガス かいかい カスカー カスカー カスティ カスティ かんしょう かんしょう かんしょう かんしょう かんしょう かんしょう はんしょう はんしょ はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょ はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょう はんしょ はんしょ はんしょ はんしょ はんしょ はんしょ はんしょ はんしょ			比较基准收益率	业绩比较基准收益	率标	(I)-(3)	(2)-(4)
动收益为零,本 3.2 基金净值 3.2.1 本报告	期基金份额净值 净值收益率①	净值收益率标准		(3)	准美4		~ ~	- 0
动收益为零,本 3.2 基金净值 3.2.1 本报告 阶段	净值收益率①	(2)						
动收益为零,本 3.2 基金净值 3.2.1 本报告 阶段 过去三个月		0.00		0.3434%		1003%	0.4572%	0.00079

注:1.本基金基金合同于2006年3月20日生效。 注:1.本基金基金合同元2006年3月20日生效。 龙基金合同规定。本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。截至本报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围,投资组合限制与基址行为的规定。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过180 天:本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%。除发生巨额赎回的情形外,本基金的投资组合中,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。 \$4 管理人报告

姓名	10 de	(日本基金的基金经理期限 (日駅日期 第任日期		证券从业年限	说明
XIA	8/37	任职日期	高任日期	ML93-99CH-H-PK	10091
魏欣	固定收益部副总 监,本基金的基金 经理	2011年4月20日	-	11	3の本年以上「報報法、現任期間で基準報目と覧」20.11年4 日本9、相任「規模行用が基金金を使用。2012年3日至今、担任日、報報行7天期時待申報基基金を使用。2012年3 り日至今、担任日、報報行7天期時待申報基基金を使用。2012年 9月3日至今、担任日、報報信約を快致作用が基金金を 場合。2014年の月2日至今。担任日、報報金約金が終日の 10.30年の月2日至今。担任日、報報を 今年基金金を行用。2013年3月24日至今。担任日、報収 年度報告報を提供。2013年3月24日至今。担任日、報収 担収 日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本日本
杜海涛	投资总监兼固定收 益都总监,本基金 的基金经理。	2013年1月7日	-	18	电流产业原基金使用有限公司银任基金经剩的股、招级营有股公司银行区间和股股股份。 证明用心,现任民党企业集团电力电路企业。 18 期间,现任民党企业集团电力电路企业。 2005年9月2 日本2015年3月21日 租任工程价价。18 是成务企业会的,2015年3月3日 年 月末2015年3月1日至今,租任工程价价。18 是成立的工程分别。 18 是成立的工程分别。18 日 18 现代企业的工程分别。 18 是成立的工程分别。18 日 18 现代企业的工程分别。 18 是成立的工程分别。18 日 18 现代企业的工程分别。 18 是成立的工程分别的工程分别。18 日 18 现代企业经营企业的工程分别。 18 是成立的工程分别有关企业的工程分别,18 日 18 现代企业经营企业的工程分别有关企业的工程分别有关企业的工程分别有关。 18 现代企业经营企业企业,18 现代企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业
王朔	本基金的基金经理	2013年11月11日	-	5	2010年加入工程環信。曾任研究部研究员、固定收益部局 员、现任国定收益部基金经理维先项货币市场研究员 年1月11日至今,担任工银价市市场基金基金经理。2014 月2日至今,担任工银价市市场基金基金经理。2014 月3日至今,担任工银师信用场场金基金经理。2015年7月10日至今,担任工银师信理金快线货币市场基金基金 提。2015年7月10日至今,担任工银师信理金快线货币市均
谷衡	固定收益部副总 监,本基金的基金 经理	2014年9月30日	-	10	東近在生軍銀行公行和任任公易员、在中信銀行公行和任 與201年期入、银票信。 與任施的企政基础设施。 與201年期入、银票信。 與任衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛衛

4.2 管理人外依它的外外基础经上跨线中间前位的以时, 本报告期外,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、勤勉尽费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

4.3.2 开帝父初17月10 4项规则 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

本基金本报告期內未出现异常交易的情况。本报告期內,本公司所有投资组合参与的交易所公开瓷价同日反向交易应交轮的单位交易量超过该证等当日成交量的5%的情况有5次,投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向定员,非导致久公平交易最初过该证等当日成交量的5%的情况有5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。 4.报告期内基金投资策略和运作分析 四季度,实体经济在前期持续下行之后出现了做弱企稳态势,主要原因是在政策进一步发力的过程中,住房,汽车等终端需求领域出现了一定程度改善,并带动企业太库存速度被缓。但由于经济反弹力度有限,通帐水平仍保持在低、货币还有企成的运输,从中一步形成经济等长级铜梯。是加充格的资金环境,债券市场收益率水平仍保持在低、货币等分至分享。并带动企业太库存速度被缓。但由于经济反弹力度有限,通帐水平仍保持在低,则不完全未发出则或自然,不行41BP。 四季度,本基金曲社对条户需求以及安观经济银济市场的判断,报收对对条户报记对公司工程等改造。同时,在实体经济产能去化压力较大的情况下。本基金一直严密债券配置的信用资质。 4.5报告期内基金的业绩表现 报告报本的未经未经验的企业,是14报告期内基金的业绩表现 报告报告的现金,并15报告期内基金的业绩表现 报告期内,基金给净值收益率。8806%,业绩比较基准收益率为0.3434%。 4.6报告期内基金的企业等2800%,业绩比较基准收益率为0.3434%。 4.6报告期内基金的有人数或基金资产净值预需说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	1	项目		金額(元)		占基金	总资产的比例(%)
1	固定收益投资			(1,015,674,197.6	9	29.90
	其中:债券				0,855,674,197.6		29.82
2	资产支持证券 买人返售金融资产		_		160,000,000.0 3,122,885,222.4		0.08
-	其中:买新式回购的买人	近傷金融资产			3,122,003,222.4	-	1.33
3	银行存款和结算备付金			13	7,083,298,829.9	14	67.17
4	其他资产				2,848,633,872.4	16	1.40
5	合计				4,070,492,122.4		100.00
	于四舍五人的原因		的比例分	项之和与合计可	J能有尾差	0	
5.2 fb 序号	设告期债券回购融资 项			,,	基金资产净值	的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余						7.31
	其中:买断式回购融资						0.00
序号	項目			金額		占基金资	产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余 其中,买断式回购融资	: 額		7,27	8,709,400.00		3.70
注.坦	共中:共断式回购通货 告期内债券融资余?	新上其全资产净值	的比例为	招生期内	· 見口動姿	全新上咨声	- 医痴儿侧的简单亚长
本报台 5.3 基	E回购的资金余额起 告期内本货币市场基 基金投资组合平均剩 投资组合平均剩余基 项目	。金债券正回购的资 余期限					
3牛期末4	· 贝曰 艾资组合平均剩余期限					天数	153
	文资组合平均剩余期限最高	6/di.					156
	设 资组合平均剩余期限最低						97
报告其	明内投资组合平均乘	余期限超过180天	情况说明				
本报行 532	告期内无投资组合平 报告期末投资组合	「均剰余期限超过1 『均剩余期限分布	80大情况 比例	0			
序号	平均剩			···占基金资产净值的	七例(%)	各期限负债占基	金资产净值的比例(%)
1	30天				7.77		3.70
	其中;剩余存续期超过				-		
2	30天(含				0.66		-
2	其中:剩余存续期超过				-		
3	60天(含 其中:剩余存结期紹言				30.66		
4	90天(含)				28.37		
	其中:剩余存续期超过				-		_
5	180天(含)=3	197天(含)			34.88		-
	其中:剩余存续期超过	1397天的浮动利率债			-		-
	合计	A MALL OR MALE VALAR			102.34		3.70
5.4 张 序号	股告期末按债券品种	分类的惯券投資组 ^{3品种}	台	摊余成本(元		F#FA	资产净值比例(%)
1	国家债券	PODIT	+	PERSON COL	2,702,281,359.7		1.37
2	央行票据				_,,,	-	-
3	金融债券				9,688,467,161.8	36	4.93
	其中:政策性金融债				9,688,467,161.8	36	4.93
4	企业债券				261,476,928.8		0.13
5	企业短期融资券				4,967,569,362.2		7.61
7	中期票据				2,382,599,056.1		1.21
8	其他					-	_
9	合计				0,855,674,197.6	59	30.95
10		7天的浮动利率债券				-	-
	:表中,债券的成本包 设告期末按摊余成本			: 它的前十夕佛:	6:17:25:1F4m		
9.5 TV	债券代码	日本5並 以)・チロル 倍森名称	7017C/14H	#/プロリ HI I → 2 H J J J J J J J J J J J J J J J J J J		etratoria.	占基金资产净值比例
					9EX	成本(元)	(%)
1	111510320	15兴业CD320		50,000,000		4,960,406,129.02	
1 2	111509221 111591926	15浦发CD221 15宁波银行CD11	10	50,000,000 30,000,000		4,960,406,129.02 2,946,645,244.64	2.52
3	111591926	15宁波银行CD1		30,000,000		2,933,549,547.79	
4	111592917	15宁波银行CD14	43	30,000,000		2,933,286,723.51	1.49
5	111592902	15杭州银行CD10		29,000,000		2,859,056,880.24	1.45
6	111591886	15宁波银行CD10		20,000,000		1,983,881,679.51	1.01
7	111514060	15江苏银行CD06	60	20,000,000		1,972,645,209.43	1.00
8	111592770 150206	15杭州银行CD05 15団开06	98	20,000,000		1,938,864,005.66	0.99
10	090205	09国开05		12,900,000		1,392,392,068.48	
			给价 。	12,700,000		ayar Polyottian (total of an	0.00
5.6 "	"影子定价"与"摊余	成本法"确定的基	金资产净	值的偏离			
		项目				偏离情况	
	編選度的绝对值在0.25(含)-	-0.5%间的次数					-
	編選度的最高值 編選度的最低值						0.0634%
	^{極高度的敗區} 每个工作日偏高度的绝对信	的结份亚色值					0.0313%
	是告期末按公允价值		:例大小扫	序的前十名资	产支持证券	投资明细	0.0470/6
序号	债券代码	债券名科		数量(份)		市值	占基金资产净值比例(%)
1	1589207	15京滅1/	A1	1,100,000		110,396,000.00	0.06
2	123744	151中信	[1	500,000		52,205,000.00	0.03
	设组合报告附注	who see to A Diversion	N sheets for Adol I			^ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_ /_	-5 mass A -1-1-1- Hr
	本基金采用固定份 买人成本列示,按票i						
	提收益或损失。	田州平以同足刊平	・ナナーラルンチに	- Name of the contract of the	31/1 DI , 1II 3	七年リオスカリドスト	11女大师中11年112月11
5.8.2	本报告期内, 本基金	金持有的剩余期限	小于397尹	- (但剩余存续期)	超过397天的	内浮动利率位	货券的摊余成本总计
`交易E	日均未超过日基金资本基金投资的前十分	が存住20%。 名証券的サゲナル	木加ナル	和 被收缩如7~	/安调本 :	北 左担生約4	日前
f、处罚	的情形。	白ய分时久11工件	4-19171111	- NUXTE H H 17	. 来. 问旦, ;	-X/1111以口 5冊Ⅱ	四日則 十四又到公
5.8.4	其他资产构成						
序号		名称			金粉	(元)	-
	存出保证金						14,911.63
1							
1 2	应收证券清算款						
1 2 3	应收利息						1,437,721,868.47
1 2							1,437,721,868.47 1,410,897,092.36

	殳资组合报告附注	主的其他文字描述部分				
无						
		§ 6 +	- 放式基	金份额变动		4671.
						单位:
报告期期初	基金份额总额					187,924,974,091.74
报告期期间	基金总申购份额					300,222,710,355.19
报告期期间	基金总赎回份额			291,521,132,147.74		
报告期期末	基金份额总额					196,626,552,299.19
注:1、 2、报告	报告期期间基金点 :期期间基金总赎	总申购份额含红利再投、 回份额含转换出份额。 §7基金管理人运		分额; 资金投资本基金交易	易明细	
序号	交易方式	交易日期		交易份額(份)	交易金額(元)	适用费率
1	红利发放	2015年10月8日		1,915,757.37	0.00	0.00%
2	红利发放	2015年11月2日		1,326,907.49	0.00	0.00%
	nda mila	essettes floori				

		§ 7 基金管理人运用	中固有贸金投资本基金交	易明细	
序号	交易方式	交易日期	交易份額(份)	交易金額(元)	适用费率
1	红利发放	2015年10月8日	1,915,757.37	0.00	0.00%
2	红利发放	2015年11月2日	1,326,907.49	0.00	0.00%
3	申购	2015年11月12日	140,000,000.00	140,000,000.00	0.00%
4	赎回	2015年11月27日	70,000,000.00	70,000,000.00	0.00%
5	红利发放	2015年12月1日	1,670,095.73	0.00	0.00%
6	赎回	2015年12月10日	250,000,000.00	250,000,000.00	0.00%
7	申购	2015年12月30日	430,000,000.00	430,000,000.00	0.00%
合计			894,912,760.59	890,000,000.00	
无。		§8 影响投資	资者决策的其他重要信息		
		§ 9	备查文件目录		

11 备查文件目录 (中国证监会批准工银瑞信货币市场基金设立的文件; 4. 红锡瑞信货币市场基金基金合同); 4. 红锡瑞信货币市场基金并管协议); 4. 基金管理人业务资格批件和营业执照; 基金产管人业务资格批件和营业执照; 3. 提金崩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 查阅万元 投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁资料不存在虚觀过载、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2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和政党合报告事为客、保证复核内客不存在虚假过载,误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤险尽责的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利。基金管理人承诺以诚实信用、勤险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。本报告申财务资料未经审计。 本报告申财务资料未经审计。 § 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

姓名	职务	任本基金的基	:金经理期限	证券从业年限	设明
XIA	8/1/20	任职日期	高任日期	HLOPOVIL THE	17091
刘伟琳	本基金的基金经理	2014年10月17日	-	5	中国人民大学金融工程榜样上2010年加入工 照信。历任金融工程分析等。按较经理助 原、投资经算、现任指数收货和基金经理。 2014年10月7日至今,担任工银空设计00指数 分级基金基金经理。2014年10月7日至今,担 任银空学业份标准。 基金经理。2015年10月7日至今,担任工银金 基金经理。2015年3月21至今,担任工银金 市中证传统报价级基金基金经理。2015年7 月24日至今,担任工银中证高秩产业指数分级基金基金经理。
		金运作遊規守信付 平格按昭《证券打		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	金合同、招募说明书等有关基金法
7 100 1 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7	(2) 中华/全田 \$4.64	日本的面別等理	和泛田甘心次之	: 左約到风险的	基础上,为基金份额持有人谋求最为

4.3 公平交易专项职用 4.31 公平交易制度的执行情况 为了公平对待各本投资人、保护各类投资人利益、避免出现不正当关联交易、利益输送等违法进期行为,公司根据 保证券投资基金产》、(基金管理公司持定案)等管理业务试点办法)、(证券投资基金管理公司公平交易制度指导 意见)等法律法期和公司内部规章、报定了《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 平对待做了间确具体的规定。并规定对实实验里、债券申核的价格和市场价格更指数人,创作存在推线规价,和益输送 等违法进期情况进行监控。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 易需求的基金号设备组合,实现开了系统中的公平交易模块出行,在公司对满足限价条件且对同一证券有相同交 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。 4.22 皇常交易行人的专业证证明

本基金及本基金管理人管理的其他投資组合之间水及生法种法规率正的以下9.2×30人人人×3。 4.3。早常交易行为的专项前期 本基金本报告期內未出現异常交易的情况。本报告期內,本公司所有投資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,采导致不公平交易和配益输送。 4.4 报告期功基金投资策略和运行分析 本报告期内,本基金银账的付款的目与编属度为0.05%,偏属度年化标准差为1.30%。本基金跟账是差产生的主要 来源是;1)标切书数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响;2)申购赎回的影响;3)成份股票的停牌;4)指 数中成份股票的财惠等。 本报告期内基金的业绩表现 本报告期内基金的业绩表现 本报告期内基金的业绩表现

4.6 报告期内基金特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 § 5 投资组合报告

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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	517,288,078.07	16.51
8	其他资产	4,608,487.91	0.15
9	□合计 3于四舍五人的原因公允价值占基金总资	3,133,819,185.70	100.00
5.2.1	设告期末按行业分类的股票投资组合 报告期末指数投资按行业分类的股票技		
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	2,393,118.0	0.09
В	采矿业	89,850,125.6	3.22
C	制造业	849,821,187.63	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,774,231.6	
E	建筑业	100,823,414.2	
F	批发和零售业	57,538,434.9	
G	交通运输、仓储和邮政业	94,322,670.78	3.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	156,276,624.0	
J	金融业	901,693,719.6	
K	房地产业	130,485,857.1	
L	租赁和商务服务业	27,240,835.73	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,540,799.70	0.81
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	州 /前		

代码	股告期末积极投资按行。 行业类别		公允价值(元)		占基金资产净值比例ea
A	农、林、牧、渔业			-	=
В	采掘业		-		-
С	制造业			-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和	1供应业		-	-
E	建筑业			-	-
F	批发和零售业			-	-
G	交通运输、仓储和邮政业			-	-
Н	住宿和餐饮业			-	-
I	信息传输、软件和信息技术	服务业		4,940,328.80	0.18
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		-		-
0	居民服务、修理和其	他服务业	-		_
P	教育		_		-
Q	卫生和社会工		_		_
R	文化、体育和娱	乐业	_		-
S	综合			-	_
	合计			4,940,328.80	0.18
	于四舍五人的原因公允的				
	告期末按公允价值占基 报告期末指数投资按公:				月细
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	601318	中国平安	2,894,288	104,194,368.	00 3.73
2	600016	民生银行	7,928,864	76,434,248.	96 2.74
		11.0 10.0 00.00			

在哪盆球后列水小对可即分。 56 报告期末处分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报告期末未持有资产支持证券。 5.7 报告期末次分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。

3.7 依告期本校公元的信白基金族("仲田比例大小排序的前五名权证投资明细本基金本报告期末特有发验属。 3.5 报告期末核与允允值占基金资产单值比例大小排序的前五名权证投资明细本基金报告期末末特有较比。 3.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况边明 本基金和投告期末本基金投资的股指期货交易情况边明 本基金本报告期末末基金投资的股指期货投制在投资。 3.9.2 本基金投资的股指期货投资政策 本报告期内、本基金未还用国债期货投资投资。 3.10.1 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本时间的期投资政策等 本报告期内、本基金未运用国债期货投资证券 本报告期内、本基金未运用国债期货投资。 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货投资报 本报告期内、本基金未运用国债期货投资。也无期间损益 5.10.3 报告期内、本基金未运用国债期货投资。 本报告期内、本基金未运用国债期货投资。 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货投资。 表现金年报告期末本基金投资的目债期货投资。 表现金年报告期末本基金投资的目债期货投资。 5.10.2 报告前未本基金投资的目债期货投资。 5.10.2 报告前人本基金未运用债期货投资。 5.10.2 报告前人本基金未运用债期货投资。 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制目前一年内受到公开谴责、 第10的投资决策程序说明。 2015年11月26日,中信证券股份有限公司收到中国证监会决定对公司进行立案调查。调查的范围是中信证券在 公司涉嫌违及《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。调查的范围是中信证券在 公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。调查的范围是中信证券在 资融券业务开展过程中,存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"规定之

投资决策流程符合公司的制度要求,目前公司经营状况良好、业绩稳定,对投资无重大影响。 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	名杯			金額(元)	
1	存出保证金				1,055,973.13
2	应收证券清算款				-
3	应收股利				-
4	应收利息				90,663.50
5	应收申购款				3,461,851.28
6	其他应收款				-
7	待摊费用				-
8	其他				-
9	合计				4,608,487.91
本基金 5.11.5	报告期末持有的处于转 本报告期末未持有可转 报告期末前十名股票中 1 报告期末指数投资前	专换债券。 中存在流通受限情	况的说明		
序是	野悪作品	野悪久称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	溶通受限情况说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§ 6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	1,654,357,066.87
报告期期间基金总申购份额	1,511,602,306.20
减:报告期期间基金总赎回份额	522,849,524.11
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	2,643,109,848.96
注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换人份额; 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
する如用 はたませる(八郎帝にはむ)□	

N CT MAINATED PRINCES	人持有的本基金份额					13,873,742.6	
报告期期间买人/申购总份额				3,822,800.			
报告期期间卖出/赎回总份额				0.			
报告期期末管理人持有的本基金份额						17,696,543.4	
设告期期末持有的	内本基金份额占基金总	份额比例(%)				0.6	
		分额含红利再投、转换人	0210197941-42	C03/G(03/G(03/G)	AMORE THE TRANSPORT	11 24 - 9 22 - 90 200	
报告期期间	基金总赎回份额			治額(份)	交易金羅(元)	活用费率	
报告期期间 7.2 基金管	基金总赎回份额 理人运用固有资	i含转换出份额。 金投资本基金交易明细				适用费率	
报告期期间 7.2 基金管	基金总赎回份额 理人运用固有资 ^{交易方式}	合转换出份额。 金投资本基金交易明细 ^{交易日期}		分額(份)	交易金額(元)		

根据基金管理人于2015年10月20日披露的《工银瑞信沪深30指数证券投资基金第七次分红公告》,2015年10月26 日本基金进行了成立以来第七次分红。 根据基金进行了成立以来第七次分红。 日本基金进行了成立以来第八次分红。 § 9 备查文件目录

9.3 查阅力式 投资者可到基金管理人或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可 在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

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报告送出日期:二〇一六年一月二十日

基金简称	工银量化第略混合
交易代码	481017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年4月26日
报告期末基金份额总额	87,572,451.80(f)
投资目标	合理分散投资,有效控制投资组合风险,追求超越业绩基准的长期投资收益。
投资策略	本基金在基本面分析的基础上,采用数量化投资管理系统,对股票进行多角度,多视 野、系统化分析研究,就造股票均建设资组合,在控制风险的前担下实现收益最大化 实现超越市场平均水平的长期投资业绩,主要包括大类资产企置策略,行业配置策 略,股票等产业效策略、债券及其他金融工具投资策略。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率 + 20%×上证国债指数指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金。其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金。低于影響型基金。属于风险较高均基金。本基金基于数量化投资管理系统进行投资。在混合型基金中国工资险种性的投资产品。
基金管理人	工銀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

3.1 主要财务指标	***************************************
3.1 <u>L</u> <u>L</u> <u>L</u> <u>L</u> <u>M</u> M 16 16	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	35,017,523.43
2.本期利润	45,176,936.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.5915
4.期末基金资产净值	198,383,210.31
5.期末基金份额净值	2.265

工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

5.1 报告期末基金资产组合情况

Ż.	职务	仕本基金的基		证券从业年限	逆明		代码	行业类别	公
		任职日期	宴任日期	MLJJ J CHL 1114	先后在Merrill Lynch Investment	Ī	A	农、林、牧、渔业	
	本基金的基金经 理		-	Manage	MangardH任海林集中基金和海林的 基基 鱼基金型是 Fore Research & Managemen担任Fore Equary Market Managemen担任Fore Equity Market Managemen担任Fore Equity Market Managemen担任Fore Comm Fundin 是基金型型,2000年加入「指導協議 等。 即任下级中球基金的选金类型, 2000年为月3日至今,担任工级企材 精造基金的基金处理,2000年4月3日 市场上海中国工场中域,企业企业是 新混合型证券投资金基金处理, 2004年6月3日至今,提任工场制信 专门共工员工资金,提供了场票信息 专门共工员工资金,提供了场票信息 专门共工员工资金,提供了场票信息 专门共工员工资金,提供了场票信息 专门共工员工资金,并任工场票信息 专门工具工资金,并任工场票信息 专门工具工资金,并任工场票信息	Ī	В	采矿业	
						Ī	С	制造业	
		2012年4月26日				Ī	D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	
						Ī	E	建筑业	
10%						Ī	F	批发和零售业	
							G	交通运输、仓储和邮政业	
							Н	住宿和餐饮业	
						Ī	I	信息传输、软件和信息技术服务业	
						Ī	J	金融业	
						Ī	К	房地产业	
人对报告	期内本基金运	上作遵规守信情况	的说明				L	租赁和商务服务业	
(人对报告期内本基金运作遵视守信籍公的说明) 即,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 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 基金份额持有人利益的行为。 交易专项规则 平交易制度的执行情况 公村各条表投资、、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 经济特各条投资、、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 经金法》、《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 排和公司内据制度。和定了《公平交易管理办法》、《显常多管理办法》,从公司管理的各类都管的公平						M	科学研究和技术服务业		
						N	水利、环境和公共设施管理业		
						0	居民服务、修理和其他服务业		
						P	教育		
					F	Q	卫生和社会工作		
					^	R	文化、体育和娱乐业		
规和公司内部规章。规定了《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 俱具体的规定,并规定的文表股票、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 记述行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足股价条件且对同一证券有相同交易							S	综合	
								会计	1

序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	164,470,418.93	82.33
	其中:股票	164,470,418.93	82.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,713,420.00	3.8
	其中:债券	7,713,420.00	3.8
	资产支持证券	-	
4	贵金属投资	-	
5	金融衍生品投资	-	
6	买人返售金融资产	20,000,000.00	10.0
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
7	银行存款和结算备付金合计	4,825,401.18	2.4
8	其他资产	2,791,423.44	1.4
9	合计	199,800,663.55	100.0

		-0						
В		采矿业			2,023,646.		1.0	
C		制造业			83,879,696.	64	42.2	
D	电力、热力、燃	气及水生产和供应业			1,089,276.	31	0.5	
E	3	建筑业			1,009,457.	76	0.5	
F	批为	2和零售业		142,668.21			0.03	
G	交通运输	、仓储和邮政业			37,786.	94	0.0	
Н	住宿	和餐饮业			11,337.	00	0.0	
I	信息传输、软件	牛和信息技术服务业			26,230,174	90	13.2	
J		金融业			27,050,694.	79	13.6	
K	ß	9地产业			1,000,917.	05	0.5	
L	和信和	1商务服务业			1,589,003.	42	0.8	
M		2和技术服务业			, , , , , ,	_		
N		和公共设施管理业			565,299	05	0.2	
0		&理和其他服务业			313,277	-	17.00	
P	ADPORTO VE	教育						
Q	TIA-	和社会工作			1,480,649.	E 4	0.7	
R		本資和娱乐业			10,256,037.	_	5.1	
S	XILV				2,551,769.		5.1	
3		综合				_		
34- 4-	工門ムナ 1 枌田田	合け ハム(人)は トサム	.79c obs V4	ARAHLI ARIZ TEL	164,470,418.		82.9	
53 抵	于四舍五人的原因 B告期末按公允价值	公儿川田口签並	5000円 5円の円	11111111111111111111111111111111111111	- 仲一百百月 り形7 Z 野 亜 投 容 田 畑	1 凡 左。		
序号	股票代码	股票名称	20000	数量(股)	公允价值(ř.)	占基金资产净值比例(%)	
1	300458	全志科技		64,914		,724,766.00	3.8	
2	300302	同有科技		102,272		,409,606.40	3.7	
3	600536	中国软件		193,939		,997,319.12	3.5	
4	300285	田瓷材料		106,790		.858,945.00	2.4	
5	601058	赛轮金字	_	536,408		,827,672.00	2.4	
7	002329	皇氏集团		171,034		,771,848.60	2.4	
_		广联达	-	223,933		,071,101.94		
8	000776	广发证券		201,425		,917,716.25	1.9	
9	000793	华闻传媒		251,000		,772,530.00	1.9	
10	002071	长城影视	n 6m A	209,200	3	,713,300.00	1.8	
5.4 指 序号	告期末按债券品种	分尖的愤劳投资 品种	组台	/\ 24/\Alt	/=\	H	基金资产净值比例(%)	
1		Footr		公允价值	7,713,420.00	E1s	3.8	
2	国家债券				7,713,420.00		3.8	
	央行票据							
3	金融债券							
-	其中:政策性金融债				_			
4	企业债券		_		_			
- 5	企业短期融资券				_			
6	中期票据				-			
7	可转债(可交换债)				-			
8	同业存单				-			
9	其他				-			
10	合计				7,713,420.00		3.8	
注:由 5.5 报	于四舍五人的原因 B告期末按公允价值	公允价值占基金 [占基金资产净值	:资产净 1比例ナ	·值的比例分项之 、小排序的前五名	2和与合计可能和 3债券投资明细	尾差。		
序号	债券代码	债券名称		数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	020082	15贴价的8		78,000		713,420.00	3.8	
本基金	告期末按公允价值 金本报告期末未持有 2告期末按公允价值	育资产支持证券。						

		资组合报告附注	ST # 45-U. (* LL -+			5 Arch (7 2017) Trans. 61		
		平基筮投资旳削十名 第程序说明:	业务的友仃主体和	· 期飯监官部门立案调查	以任报古编制日目	前一年内受到公开谴责、划	-	
ÞIJ	广发证							
	违规行	为:						
_						MS系统)开放接人。同年		
						,广发证券上海分公司为		
型	铭创软件	技术有限公司系统(以下简称铭创系统	·)安装第三个交易网关	。对于上述外部接	人的第三方交易终端软件 了解。截止调查日,广发证	÷,	
包	友证券不 白由右12	进行纵针以证针引,7 3个使用HOMS系统	代对外部赤犹接人 绞剑玄结按人的士	头爬有双官理,对相大名:	\$尸身份育优畎之 。 \$证券未必售安 白	」	牙を	
ř	· 京易终端	信息的直字性。准确	性, 完整性, 一致性	1. 可读性,未采取可靠抗	昔施采集,记录与2	交易终端信息,未能确保 客户身份识别有关的信息	ũ	
20	15年5月2	5日,广发证券已知悉	医并关注HOMS系统	充等系统存在引发违规的	记资及违反账户实:	名制管理有关规定等问题	ı,	
,			识别信息的情况了	、未实施有效的了解客	户身份的回访、检查	至等程序。		
	处分类			tonica complete A. Doniella Co., and	. S. cata Same Marine A. alabamat	44 TEMPO AND A SECULO		
				规定,业监会拟决定:对	厂发业券贡令整改	(,给予警告,没收违法所	8	
58		元,并处以20415407.2 签法程符合公司的制		经营状况良好,业绩稳定	7 计协资于重十影	Drin		
	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。	上, 州汉贝儿里八郎	메일소		
		其他资产构成	TYNY NORTH WORK	I PONUACHO EL ASIAZACIO-PO				
	序号	名利			金額(元)			
	1	存出保证金				189,701.60		
	2	应收证券清算款				2,004,430.56		
	3	应收股利				_		
	4	应收利息				67.464.96		
	5	应收申购款		529.826.32				
		其他应收款				529,826.32		
	6					-		
	7	待摊费用				-		
	8	其他				-		
	9	合计		- M. 1977		2,791,423.44		
	5.11.4	报告期末持有的处于 本报告期末未持有可	转股期的可转换位 ***	7 寿明细				
	平	平板百朔木木行有引 报告期末前十名股票	和探贝牙。 中左左流涌号阻信	57早 (chi) 688				
			11 1-1-1-1	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	A CONTROL OF STREET THE CONTROL OF STREET		
	序号	股票代码	股票名称	(元)	(%)	流通受限情况说明		
	1	601058	赛轮金宇	4,827,672.00	2.43	重大事項		
		投资组合报告附注的	其他文字描述部分		,	·		
	无。			777 1 1 1 day 6 10 day 1 1 and				
			§ 6	开放式基金份额变动		64 LL	m	
	Arr Al- thatbals	1基金份额总额				单位:	Ħ	
		基金总申购份额			28,653,342.35			
		用问基金总赎回份额	15,004,980.91					
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								
		设告期期间基金总申 则		、转换人份额;				
	2、报告	期期间基金总赎回份		1 二 田田 七 次 人 和 次 十	tt: A. laterill			
	71 莊	金管理人持有本基金		人运用固有资金投资本	全 面目の			
	无。	正日/王//11.日小伊正	(/) DR3K2K24) [F] (/L					
		金管理人运用固有资	金投资本基金交易	明细				
			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的	信息			
	无			《9 各杏文件目录				

无。	
3 0 7 DEPCE DE DE TREE DE	自
报告期期初基金份额总额	73,924,0
报告期期间基金总申购份额	28,653,3
减报告期期间基金总赎回份额	15,004,9
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	87,572,4
2.报告期期间基金总赎回份额合转换出份额。	
1 中国正监会批准工程期信基本面量化缩解得尽型证券投资基金设立的文件; 2、(工银销信基本面量化缩解得企业证券投资基金基金合同); 3、(工银销信基本面量化频解得企业证券投资基金托管协议); 4.基金管理人业务资格批杆和营业处照; 5.基金管型人业务资格批杆和营业处照; 6.报告期内基金管理人在肯定报刊上按需的各项公告。 2.2 存放他后;	

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。