工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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：中国银行股份有限公司
送出日期：二〇一六年三月二十八日

§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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月23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。
本报告期自2015年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银量化策略混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	87,572,451.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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，精选投资标的建设资组合，在控制风险的前提下实现收益最大化，实现超越市场平均水平的长期投资业绩。主要包括大类资产配置策略、行业配置策略、股票资产投资策略、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，低于股票型基金，属于风险较高的基金。本基金基于数量化投资管理系统进行投资，在混合型基金中属于风险中性的投资产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	王永民
	联系电话	400-811-9999	010-66594896
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942

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

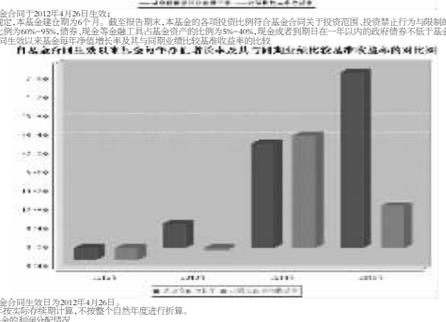
3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	91,995,369.99	47,904,528.10	141,308,180.83
本期利润	82,978,746.33	55,003,099.02	79,522,276.07
加权平均基金份额本期利润	0.9612	0.2945	0.1500
本期基金份额净值增长率	60.30%	35.87%	8.33%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	1.2654	0.4130	0.0397
期末基金资产净值	198,383,210.31	160,671,130.07	259,071,075.67
期末基金份额净值	2.265	1.413	1.040

注：(1)上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”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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
（4）本基金基金合同生效日为2012年4月26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	36.45%	1.98%	15.35%	1.38%	21.10%	0.60%
过去六个月	-0.61%	3.30%	-11.74%	2.19%	11.13%	1.11%
过去一年	60.30%	2.83%	14.50%	2.00%	45.80%	0.83%
过去三年	135.94%	1.92%	57.39%	1.42%	78.55%	0.50%
自基金合同生效起至今	126.50%	1.77%	50.93%	1.35%	75.57%	0.42%

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2012年4月26日生效。
2.根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定；本基金的股票资产占基金资产的比例为60%~95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%~40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
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



注：1.本基金基金合同生效日为2012年4月26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
本基金过去三年均未实施利润分配。

§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业务管理资格、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，全国社保基金投资管理人资格。
截至2015年12月31日，公司旗下管理74只公募基金——工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、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、工银瑞信稳健长混合型证券投资基金、工银瑞信增盈积极债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信市场先锋灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数证券投资基金、工银瑞信沪深300指数增强证券投资基金、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混合型证券投资基金、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100指数证券投资基金、工银瑞信ETF联接基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信信誉债券分红债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业主题股票型证券投资基金、工银瑞信主题策略混合型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数证券投资基金、工银瑞信量化策略混合型证券投资基金、工银瑞信本面量化策略混合型证券投资基金、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、工银瑞信普惠保证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、工银瑞信理财债券型证券投资基金、工银瑞信500天理财债券型证券投资基金、工银瑞信保本2号混合型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信稳健成长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、工银瑞信基金产业股票型证券投资基金、工银瑞信基金主题股票型证券投资基金、工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信可转换债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、工银瑞信月月新定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添利债券型证券投资基金、工银瑞信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信中证申能新能源指数分级证券投资基金、工银瑞信高铁指数分级证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信新金属行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数增强证券投资基金、工银瑞信稳健收益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、工银瑞信月月新定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添利债券型证券投资基金、工银瑞信