基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:二〇一六年三月二十八日

工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月18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，投资者在投资基金前应认真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	工银深证100指数分级		
场内简称	100母基		
基金主代码	164811		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年10月25日		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	27,228,759.14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	2012-11-05		
下属分级基金的基金简称	深100A	深100B	100母基
下属分级基金的交易代码	150112	150113	164811
报告期末下属分级基金份额总额	10,872,969.00份	10,872,970.00份	5,482,820.14份

注:根据相关法律文件的规定,决定自2015年7月22日起将上银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金之基础份额(代码:164811)的5%向场外转出"工银100"更名为"100母基",将上银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(代码:150112)的场内简称由"工银100A"更名为"深100A",将上银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金之积极进取类份额(代码:150113)的场内简称由"工银100B"更名为"深100B"。

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股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及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。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0.35%,偏离度年化标准差不超过4%。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,其风险与收益高于一般的指数型基金。本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,其风险与收益高于一般的指数型基金。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。深证100A分额具有较风险、低预期收益的特征;深证100B分额具有高风险、高预期收益的特征。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	罗菲菲
	联系电话	400-811-9999	010-58560666
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgbd@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	95568
传真		010-66583158	010-58560798

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办公场所

§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	-47,959,040.30	2,864,738.46	6,118,133.40
本期利润	-62,766,639.63	7,831,462.15	-708,357.93
加权平均基金份额本期利润	-1.2408	0.2135	-0.0142
本期基金份额净值增长率	22.87%	28.65%	-6.06%
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	-0.1407	0.1556	-0.0052
期末基金资产净值	39,480,021.11	37,482,398.77	36,290,497.69
期末基金份额净值	1.4499	1.2047	0.9716

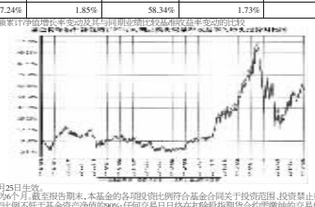
注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
3.本基金基金合同生效日为2012年10月25日。

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

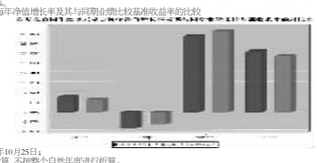
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	28.50%	1.95%	24.48%	1.89%	4.02%	0.06%
过去六个月	-8.99%	3.16%	-12.13%	2.76%	3.14%	0.40%
过去一年	22.87%	2.73%	21.11%	2.46%	1.76%	0.27%
过去三年	48.49%	1.88%	50.98%	1.75%	-2.49%	0.13%
自基金合同生效以来	57.24%	1.85%	58.34%	1.73%	-1.10%	0.12%

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10月25日生效。
2.根据合同规定,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;本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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.本基金合同生效日为2012年10月25日;
2.合同生效当年按不满一个年度计算,不按整个自然年度进行折算。
3.1 过去一年基金净值增长率=0.00%
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、工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金、工银瑞信增利收益债券型证券投资基金、工银瑞信中证500指数证券投资基金、工银瑞信中证机会主题配置股票证券投资基金、工银瑞信沛禾利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金、工银瑞信产业债债券证券投资基金、工银瑞信产业债债券证券投资基金、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、工银瑞信双利债券型证券投资基金、工银瑞信双核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、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信瑞利灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞利灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞利灵活配置