

## 工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

## 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
游洋峰	本基金的基金经理	2012年4月26日	20	先后在 Merrill Lynch Investment Managers担任美林集中基金和美林保本基金基金经理。Fore Research & Management担任Fore Equity Market Neutral基金经理。Jasper Gemini担任Jasper Gemini基金基金经理。 2009年加入工银瑞信基金管理有限公司； 2009年12月25日至至今担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理，2010年5月25日至至今担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理。 先后在海通证券担任基金经理，现就职于国都证券担任国都投资总部总经理，中国再保险资产管理有限公司任固定收益投资部助理总经理、研究发展部助理总经理，招商基金管理有限公司任固定收益部基金经理，经济学家兼研究总监兼基金经理； 2010年加入工银瑞信，曾任客户投资总监，同时担任工银瑞信量化策略股票型基金基金经理。

## § 2 基金产品概况

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

43,040,201.31

2.本期利润

15,565,200.88

3.加权平均基金份额本期利润

0.052

4.期末基金份额净值

448,776,402.91

5.期末基金份额总额

0.957

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“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.1 本报告期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

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -0.83% 1.37% -8.21% 1.15% 7.38% 0.22%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

43,040,201.31

2.本期利润

15,565,200.88

3.加权平均基金份额本期利润

0.052

4.期末基金份额净值

448,776,402.91

5.期末基金份额总额

0.957

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“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.3 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -4.61% 1.06% -6.76% 0.88% 2.15% 0.18%

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

-36,051,275.70

2.本期利润

-195,026,399.94

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0226

4.期末基金份额净值

4,056,645,656.38

5.期末基金份额总额

0.4779

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)本期利润“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.4 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -4.61% 1.06% -6.76% 0.88% 2.15% 0.18%

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

-36,051,275.70

2.本期利润

-195,026,399.94

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0226

4.期末基金份额净值

4,056,645,656.38

5.期末基金份额总额

0.4779

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)本期利润“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.6 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -4.61% 1.06% -6.76% 0.88% 2.15% 0.18%

3.2.7 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

-36,051,275.70

2.本期利润

-195,026,399.94

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0226

4.期末基金份额净值

4,056,645,656.38

5.期末基金份额总额

0.4779

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)本期利润“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.8 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -4.61% 1.06% -6.76% 0.88% 2.15% 0.18%

3.2.9 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

-36,051,275.70

2.本期利润

-195,026,399.94

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0226

4.期末基金份额净值

4,056,645,656.38

5.期末基金份额总额

0.4779

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)本期利润“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.10 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -4.61% 1.06% -6.76% 0.88% 2.15% 0.18%

3.2.11 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期已实现收益

-36,051,275.70

2.本期利润

-195,026,399.94

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0226

4.期末基金份额净值

4,056,645,656.38

5.期末基金份额总额

0.4779

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)本期利润“指本基金本期利息收入、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)扣除相关费用后的余额。数据列示截止到2013年6月30日。  
3.2.12 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率标准差④

①-③

②-④

过去三个月 -4.61% 1.06% -6.76% 0.88% 2.15% 0.