

# 工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金 (QDII) 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 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：二〇一九年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 2019 年 8 月 26 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、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>

6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	48
7.11 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	53

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）
基金简称	工银香港中小盘
基金主代码	002379
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月9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	62,738,111.66份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在香港上市的中小盘中国概念股票，持续关注经济转型中新业态和政策扶持的行业带来的投资机会，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金运用国际化的视野审视中国经济和资本市场，依据定量和定性相结合的方法，考虑经济情景、类别资产收益风险预期等因素，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在股票选择策略方面，本基金的股票资产主要投资于在香港及其他境外证券市场交易的中小盘中国概念股，其中投资于香港上市的中小盘中国概念股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金建立了系统化、纪律化的投资流程，遵循初选投资对象、成长性评估、投资吸引力评估、组合构建及优化等过程，选择具有投资价值的中小盘股票，构造投资组合。
业绩比较基准	恒生综合中型股指数收益率×50%+恒生综合小型股指数收益率×30%+香港三个月期银行同业拆借利率×20%。
风险收益特征	本基金是投资于香港等海外市场中小盘中国概念股的股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	姓名	朱碧艳	王永民

人	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
注册地址		北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		王海璐	刘连舸

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

注：本基金本报告期末聘请境外投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-16,773,685.59
本期利润	5,831,400.08
加权平均基金份额本期利润	0.0854
本期加权平均净值利润率	7.56%
本期基金份额净值增长率	9.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-4,696,139.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0749
期末基金资产净值	72,534,596.86
期末基金份额净值	1.156
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	15.60%

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、本期已实现收益是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、期末可供分配利润为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；

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日；

5、本基金基金合同生效日为2016年3月9日。

#### 3.2 基金净值表现

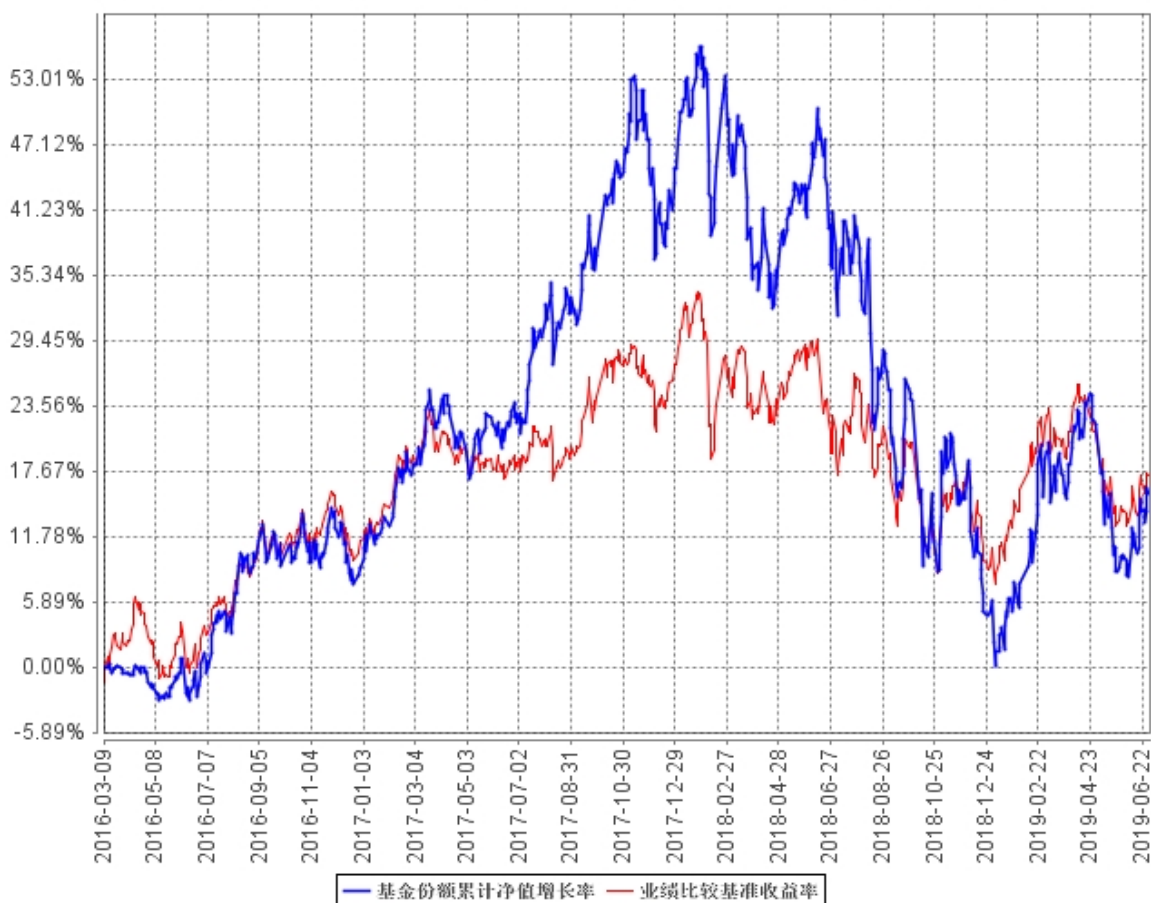
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.00%	1.28%	2.75%	0.84%	2.25%	0.44%
过去三个月	-2.20%	1.31%	-3.24%	0.94%	1.04%	0.37%
过去六个月	9.06%	1.36%	6.02%	0.92%	3.04%	0.44%
过去一年	-17.96%	1.61%	-4.32%	1.08%	-13.64%	0.53%
过去三年	15.25%	1.28%	14.44%	0.90%	0.81%	0.38%
自基金合同生效以来	15.60%	1.23%	17.36%	0.90%	-1.76%	0.33%



### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2016年3月9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，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票的投资比例不少于基金资产的80%，其中投资于香港市场上上市的中小盘中国概念股票的比例不低于非现金基金资产的80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 3.3 其他指标

无。

## §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，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。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、QFII、RQFII等多项业务资格。

截至2019年6月30日，公司旗下管理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、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信60天理财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、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证50交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）等逾130只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游凇峰	本基金的基金经理	2018年10月24日	-	23	斯坦福大学统计学专业博士；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组

					合基金经理，Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金经理；2009 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资部量化投资团队负责人；2009 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银全球精选股票基金的基金经理；2012 年 4 月 26 日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理；2014 年 6 月 26 日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理；2015 年 12 月 15 日至 2017 年 12 月 22 日，担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理；2016 年 3 月 9 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理；2016 年 10 月 10 日至 2018 年 2 月 23 日，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 27 日至今，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 10 月 24 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）基金经理。
赵完成	本基金的基金经理	2018 年 12 月 25 日	-	19	先后在第一金证券、统一投信担任分析师，在群益投信担任资深分析师、基

					金经理，在永丰投信担任资深分析师，在华顿投信、日盛投信担任基金经理；2018年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，2018年12月25日至今，担任工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期末聘请境外投资顾问。

## 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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文件的规定，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利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《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明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。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等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本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。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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场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，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

工银瑞信香港中小盘基金在2019年上半年的组合收益率为9.06%，基准收益率为6.02%，基金领先基准收益率3.04%。

一季度指数明显反弹，主要受到美联储鸽派言论、中美贸易谈判持续进展与经济数据企稳（一月社融以及三月PMI回升至50以上），基金在一季度调整持仓至技术硬件、半导体、食品饮料与多元金融等细分赛道，取得正超额收益；二季度指数震荡激烈，除了全球在大涨之后开始震荡，中央政治局会议“稳增长”和“防风险”的边际力度开始减弱，以及中美贸易开始波折、美国增加2000亿元商品关税，叠加华为被列入美国出口管制名单，基金在市场下跌过程中，调整持股比重持续降仓，也调整持仓至均衡配置避免收益率巨幅波动，基金净值仍超越基准收益率。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为9.06%，业绩比较基准收益率为6.02%。

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6月底G20高峰会中美达成沟通共识，有利于缓解市场对下半年出口增速进一步下行的担忧，叠加下半年美联储将开始降息，全球资金仍处于宽松阶段；国内在前期减税降费背景下，预计消费和制造业投资将维持平稳，上行弹性不足，在全球经济增速放缓的背景下，预计下半年出口增速大概率还将维持上半年零增长附近震荡格局。

类股投资方向，一、看好产业景气在成长阶段、业绩明确度高的成长股，如：猪周期、5G、半导体（华为供应链）、光伏；二、看好政策偏多以及产业壁垒已经完成的龙头大白马股，如：金融（券商）、地产、消费。

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 参与估值流程各方及人员或小组的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

#### 4.7.1.1 职责分工

4.7.1.1.1 参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

4.7.1.1.2 各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

#### 4.7.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

#### 4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

#### 4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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件。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,874,844.19	23,717,426.38
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	68,436,734.94	126,498,858.38
其中：股票投资		68,436,734.94	126,498,858.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		453,249.40	3,714,056.22
应收利息	6.4.7.5	262.23	633.08
应收股利		493,630.34	35,113.23
应收申购款		130,488.77	154,599.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		73,389,209.87	154,120,686.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		639,817.56	26,886,055.68
应付管理人报酬		104,085.70	238,340.80
应付托管费		20,238.89	46,344.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,470.86	214,401.75
负债合计		854,613.01	27,385,142.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	62,738,111.66	119,535,094.45
未分配利润	6.4.7.10	9,796,485.20	7,200,450.06
所有者权益合计		72,534,596.86	126,735,544.51
负债和所有者权益总计		73,389,209.87	154,120,686.75

注： 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.156 元，基金份额总额为 62,738,111.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		7,076,252.33	-6,456,731.61
1.利息收入		9,350.63	40,249.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,350.63	40,249.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-15,391,153.22	27,366,366.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-16,238,098.16	24,677,312.84
基金投资收益	6.4.7.13	-	-357,436.25
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	36,299.62	-
股利收益	6.4.7.17	810,645.32	3,046,490.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	22,605,085.67	-35,568,954.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-209,312.25	1,358,628.74
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	62,281.50	346,977.67

列)			
<b>减：二、费用</b>		1,244,852.25	5,827,958.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	689,636.79	3,211,236.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,096.07	624,407.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	310,829.69	1,802,665.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	110,289.70	189,650.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,831,400.08	-12,284,690.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,831,400.08	-12,284,690.59

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	119,535,094.45	7,200,450.06	126,735,544.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	5,831,400.08	5,831,400.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-56,796,982.79	-3,235,364.94	-60,032,347.73
其中：1.基金申购款	13,794,152.79	1,990,535.83	15,784,688.62
2.基金赎回款	-70,591,135.58	-5,225,900.77	-75,817,036.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-



永道中天验字(2016)第200号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金(QDII)基金合同》于2016年3月9日正式生效,基金合同生效日工银香港中小盘人民币份额241,387,482.19份基金份额和工银香港中小盘美元份额357,799.04份基金份额,其中认购资金利息折合工银香港中小盘人民币份额44,310.86份基金份额与工银香港中小盘美元份额8.45份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”),境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金(QDII)基金合同》和《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金(QDII)招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同,将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为人民币份额;以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为美元份额。本基金对人民币基金份额和美元基金份额分别设置代码,分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别,并交付相应币种的款项。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于境外市场依法发行的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,具体包括:已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括ETF);中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资比例为:股票的投资比例不少于基金资产的80%,其中投资于香港市场上市的中小盘中国概念股票的比例不低于非现金基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:恒生综合中型股指数收益率 $\times$ 50%+恒生综合小型股指数收益率 $\times$ 30%+香港三个月期银行同业拆借利率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增

值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	3,874,844.19
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	3,874,844.19

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,733,966.79	68,436,734.94	4,702,768.15
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	63,733,966.79	68,436,734.94	4,702,768.15

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	262.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	262.23

### 6.4.7.6 其他资产

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

无。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,235.07
预提信息披露费	57,995.19
预提审计费	31,240.60
合计	90,470.86

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	119,535,094.45	119,535,094.45
本期申购	13,794,152.79	13,794,152.79
本期赎回(以“-”号填列)	-70,591,135.58	-70,591,135.58
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	62,738,111.66	62,738,111.66

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,840,941.36	-6,640,491.30	7,200,450.06
本期利润	-16,773,685.59	22,605,085.67	5,831,400.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,763,394.98	-1,471,969.96	-3,235,364.94
其中：基金申购款	-855,176.08	2,845,711.91	1,990,535.83
基金赎回款	-908,218.90	-4,317,681.87	-5,225,900.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,696,139.21	14,492,624.41	9,796,485.20



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	9,350.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	9,350.63

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	137,888,197.46
减：卖出股票成本总额	154,126,295.62
买卖股票差价收入	-16,238,098.16

**6.4.7.13 基金投资收益**

无。

**6.4.7.14 债券投资收益**

无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出权证成交总额	36,299.62
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-

买卖权证差价收入	36,299.62
----------	-----------

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	810,645.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	810,645.32

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	22,605,085.67
——股票投资	22,605,085.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	22,605,085.67

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	54,816.84
其他	7,464.66
合计	62,281.50

### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	310,829.69
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	310,829.69

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	31,240.60
信息披露费	57,995.19
其他	13,271.71
银行费用	7,782.20
合计	110,289.70

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
中国银行（香港）有限公司	境外资产托管人

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	689,636.79	3,211,236.18
其中：支付销售机构的客户维护费	257,212.18	382,243.45

注：1、基金管理费按前一估值日的基金资产净值的1.8%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一估值日的基金资产净值

2、基金管理人的管理费每日计提，按月支付。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	134,096.07	624,407.03

注：1、基金托管费按前一估值日的基金资产净值的0.35%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一估值日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行（香港）有限公司	1,110,682.18	-	43,534,790.69	-
中国银行股份有限公司	2,764,162.01	9,350.63	19,784,177.56	40,249.78

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，利息收入（本期）仅为活期存款利息收入；

2、上年度可比期间报告期末余额仅为活期存款，利息收入（上年度可比期间）仅为活期存款利息收入；

3、本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和基金境外资产托管人中国银行（香港）有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

## **6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

## **6.4.13 金融工具风险及管理**

### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施

监控措施。在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策，公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每



个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,874,844.19	-	-	-	-	-	3,874,844.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	68,436,734.94	68,436,734.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-	453,249.40	453,249.40
应收利息	-	-	-	-	-	262.23	262.23
应收股利	-	-	-	-	-	493,630.34	493,630.34
应收申购款	-	-	-	-	-	130,488.77	130,488.77
资产总计	3,874,844.19	-	-	-	-	69,514,365.68	73,389,209.87
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	639,817.56	639,817.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	104,085.70	104,085.70
应付托管费	-	-	-	-	-	20,238.89	20,238.89
其他负债	-	-	-	-	-	90,470.86	90,470.86
负债总计	-	-	-	-	-	854,613.01	854,613.01
利率敏感度缺口	3,874,844.19	-	-	-	-	68,659,752.67	72,534,596.86
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,559,607.89	-	-	-	-	15,157,818.49	23,717,426.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	126,498,858.38	126,498,858.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,714,056.22	3,714,056.22
应收利息	-	-	-	-	-	633.08	633.08
应收股利	-	-	-	-	-	35,113.23	35,113.23
应收申购款	-	-	-	-	-	154,599.46	154,599.46
资产总计	8,559,607.89	-	-	-	-	145,561,078.86	154,120,686.75
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,886,055.68	26,886,055.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	238,340.80	238,340.80
应付托管费	-	-	-	-	-	46,344.01	46,344.01
其他负债	-	-	-	-	-	214,401.75	214,401.75
负债总计	-	-	-	-	-	27,385,142.24	27,385,142.24

利率敏感度缺口	8,559,607.89	-	-	-	-	-118,175,936.62	126,735,544.51
---------	--------------	---	---	---	---	-----------------	----------------

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	1,699,706.46	1,031,077.50	2,730,783.96
交易性金融资产	7,449,045.85	60,987,689.09	68,436,734.94
应收股利	-	55,802.99	55,802.99
应收利息	23.58	-	23.58
应收申购款	1,117.62	-	1,117.62
应收证券清算款	-	453,249.40	453,249.40
资产合计	9,149,893.51	62,527,818.98	71,677,712.49
以外币计价的负债			
应付赎回款	15,773.79	-	15,773.79
其他负债	18.84	-	18.84
负债合计	15,792.63	-	15,792.63
资产负债表外汇风险敞口净额	9,134,100.88	62,527,818.98	71,661,919.86
项目	上年度末 2018年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	5,951,231.09	15,157,859.35	21,109,090.44
应收利息	90.73	-	90.73
应收股利	35,113.23	-	35,113.23

交易性金融资产	14,308,510.55	112,190,347.83	126,498,858.38
应收证券清算款	-	3,714,056.22	3,714,056.22
应收申购款	1,356.37	-	1,356.37
资产合计	20,296,301.97	131,062,263.40	151,358,565.37
以外币计价的负债			
其它负债	147.01	-	147.01
应付赎回款	67,184.07	-	67,184.07
负债合计	67,331.08	-	67,331.08
资产负债表外汇风险敞口净额	20,228,970.89	131,062,263.40	151,291,234.29

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除本基金的单一外币汇率变化 5% 以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	美元相对人民币升值 5%	456,705.04	1,011,448.54
	美元相对人民币贬值 5%	-456,705.04	-1,011,448.54
	港币相对人民币升值 5%	3,126,390.95	6,553,113.17
	港币相对人民币贬值 5%	-3,126,390.95	-6,553,113.17

注：1、表中列示了当年以外币计价的资产中前五大币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

2、标记“-”处，表示当年该币种的汇率风险较小。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于境外市场依法发行的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的

分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	68,436,734.94	94.35	126,498,858.38	99.81
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	68,436,734.94	94.35	126,498,858.38	99.81

注：1、本基金投资组合的范围为：股票的投资比例不少于基金资产的80%，其中投资于香港市场上市的中小盘中国概念股票的比例不低于非现金基金资产的80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

2、由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变； 用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准增加5%	4,941,265.17	8,178,800.00
	业绩比较基准减少5%	-4,941,265.17	-8,178,800.00

注：本基金管理人运用定量分析等方法对本基金的其他价格风险进行分析。表中为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	68,436,734.94	93.25
	其中：普通股	66,053,669.41	90.00
	存托凭证	2,383,065.53	3.25
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,874,844.19	5.28
8	其他各项资产	1,077,630.74	1.47
9	合计	73,389,209.87	100.00

注：由于四舍五入的原因市值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	60,987,689.09	84.08
美国	7,449,045.85	10.27
合计	68,436,734.94	94.35

注：1、权益投资的国家类别根据其所在证券交易所确定；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
信息技术 Information Technology	19,830,409.35	27.34
金融 Financials	13,514,220.10	18.63
必需消费品 Consumer Staples	12,883,298.05	17.76
房地产 Real Estate	5,617,605.53	7.74
工业 Industrials	5,282,907.03	7.28
公共事业 Utilities	4,164,336.83	5.74
非必需消费品 Consumer Discretionary	4,105,278.14	5.66
保健 Health Care	2,263,259.62	3.12
通信服务 Communication Services	775,420.29	1.07
合计	68,436,734.94	94.35

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	WH Group Ltd	万洲国际	KYG960071028	香港证券交易所	中国香港	828,500	5,772,082.62	7.96
2	New China Life Insurance Co Ltd	新华保险	CNE100001922	香港证券交易所	中国香港	110,500	3,693,692.34	5.09

				所				
3	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	KYG8586D1097	香港证券交易所	中国香港	48,000	3,407,450.98	4.70
4	Xinyi Solar Holdings Ltd	信义光能	KYG9829N1025	香港证券交易所	中国香港	989,298	3,350,446.63	4.62
5	Flat Glass Group Co Ltd	福莱特	CNE100002375	香港证券交易所	中国香港	935,000	3,281,703.58	4.52
6	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能源	KYG3066L1014	香港证券交易所	中国香港	48,300	3,229,055.93	4.45
7	QUALCOMM Inc	高通公司	US7475251036	纳斯达克证券交易所	美国	5,781	3,023,222.68	4.17
8	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太保	CNE1000009Q7	香港证券交易所	中国香港	110,000	2,956,097.43	4.08



				所				
9	Tsingtao Brewery Co Ltd	青岛啤酒	CNE1000004K1	香港证券交易所	中国香港	62,000	2,713,311.27	3.74
10	Sunac China Holdings Ltd	融创中国	KYG8569A1067	香港证券交易所	中国香港	69,000	2,330,747.14	3.21
11	China Vanke Co Ltd	万科	CNE100001SR9	香港证券交易所	中国香港	85,700	2,208,835.06	3.05
12	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	HK0000218211	香港证券交易所	中国香港	157,000	2,088,172.09	2.88
13	PICC Property & Casualty Co Ltd	中国人民财产保险股份有限公司	CNE100000593	香港证券交易所	中国香港	278,000	2,061,518.40	2.84
14	China Everbright Bank Co Ltd	光大银行	CNE100001QW3	香港证券交易所	中国香港	630,000	1,983,985.16	2.74
15	Shenzhou	申洲	KYG8087W1015	香	中国	18,800	1,776,139.10	2.45

	International Group Holdings Ltd	国际		港 证 券 交 易 所	香港			
16	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润啤酒	HK0291001490	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	52,000	1,697,040.07	2.34
17	Huatai Securities Co Ltd	华泰证券	CNE100001YQ9	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	127,600	1,508,567.64	2.08
18	China Mengniu Dairy Co Ltd	蒙牛乳业	KYG210961051	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	55,000	1,463,534.33	2.02
19	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	金风科技	CNE100000PP1	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	193,970	1,457,160.13	2.01
20	Haitian International Holdings Ltd	海天国际	KYG4232C1087	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	100,000	1,426,808.52	1.97
21	Kingdee International Software Group Co	金蝶国际	KYG525681477	香港 证	中国 香港	183,000	1,360,262.24	1.88

	Ltd			券交易所				
22	CITIC Securities Co Ltd	中信证券	CNE1000016V2	香港证券交易所	中国香港	91,500	1,310,359.13	1.81
23	Advanced Micro Devices Inc	-	US0079031078	纳斯达克证券交易所	美国	6,215	1,297,596.53	1.79
24	Daqo New Energy Corp	大全新能源公司	US23703Q2030	纽约证券交易所	美国	4,382	1,276,393.51	1.76
25	COFCO Meat Holdings Ltd	中粮肉食	KYG226921008	香港证券交易所	中国香港	541,000	1,237,329.76	1.71
26	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd	东阳光药	CNE1000023R6	香港证券交易所	中国香港	35,400	1,216,015.59	1.68
27	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团	US01609W1027	纽约证	美国	950	1,106,672.02	1.53

		控 股 有 限 公 司		券 交 易 所				
28	China Jinmao Holdings Group Ltd	中国金茂	HK0817039453	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	258,000	1,078,023.33	1.49
29	CIMC Enric Holdings Ltd	中集安瑞科	KYG2198S1093	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	194,000	1,075,120.45	1.48
30	Sino Biopharmaceutical Ltd	中国生物制药	KYG8167W1380	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	149,000	1,047,244.03	1.44
31	China Gas Holdings Ltd	中国燃气	BMG2109G1033	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	36,600	935,280.90	1.29
32	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	中远海能	CNE1000002S8	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	200,000	812,805.84	1.12
33	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	KYG875721634	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	2,500	775,420.29	1.07

				易所				
34	NVIDIA Corp	英伟达	US67066G1040	纳斯达克证券交易所	美国	660	745,161.11	1.03
35	Maoyan Entertainment	猫眼娱乐	KYG5804A1076	香港证券交易所	中国香港	55,800	632,215.16	0.87
36	China Education Group Holdings Ltd	中教控股	KYG2163M1033	香港证券交易所	中国香港	55,000	590,251.86	0.81
37	Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	三一国际	KYG781631059	香港证券交易所	中国香港	206,000	511,012.09	0.70

注：上表所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Sunny Optical Technology	KYG8586D1097	6,569,943.14	5.18

	Group Co Ltd			
2	Xinyi Solar Holdings Ltd	KYG9829N1025	3,442,165.18	2.72
3	QUALCOMM Inc	US7475251036	3,372,732.90	2.66
4	Huatai Securities Co Ltd	CNE100001YQ9	3,030,223.76	2.39
5	ZTE Corp	CNE1000004Y2	2,731,448.61	2.16
6	Flat Glass Group Co Ltd	CNE100002375	2,650,303.81	2.09
7	Sunac China Holdings Ltd	KYG8569A1067	2,321,800.96	1.83
8	NVIDIA Corp	US67066G1040	2,319,650.85	1.83
9	China Education Group Holdings Ltd	KYG2163M1033	2,007,971.75	1.58
10	Sands China Ltd	KYG7800X1079	1,934,286.23	1.53
11	AAC Technologies Holdings Inc	KYG2953R1149	1,910,537.80	1.51
12	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	CNE100000PP1	1,780,621.03	1.40
13	China Youzan Ltd	8083 HK	1,613,966.20	1.27
14	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd	CNE1000023R6	1,591,764.44	1.26
15	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	CNE100000Q35	1,542,137.60	1.22
16	Haitian International Holdings Ltd	KYG4232C1087	1,528,211.76	1.21
17	Shenzhou International Group Holdings Ltd	KYG8087W1015	1,511,160.03	1.19
18	CITIC Securities Co Ltd	CNE1000016V2	1,479,408.93	1.17
19	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	CNE100001M79	1,476,204.93	1.16
20	Sino Biopharmaceutical Ltd	KYG8167W1380	1,404,056.86	1.11

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用；

3、上表所用证券代码采用 ISIN 代码，没有 ISIN 代码的采用当地市场代码。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	CIMC Enric Holdings Ltd	KYG2198S1093	6,587,028.41	5.20
2	China Pacific Insurance	CNE1000009Q7	6,274,428.02	4.95

	Group Co Ltd			
3	ZTE Corp	CNE1000004Y2	6,160,524.74	4.86
4	CRRC Corp Ltd	CNE100000BG0	5,749,668.20	4.54
5	New China Life Insurance Co Ltd	CNE100001922	4,732,471.06	3.73
6	China Vanke Co Ltd	CNE100001SR9	4,486,751.11	3.54
7	PICC Property & Casualty Co Ltd	CNE100000593	4,444,111.54	3.51
8	Sun Art Retail Group Ltd	HK0000083920	4,058,351.88	3.20
9	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	HK0000055878	3,948,862.25	3.12
10	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	KYG8586D1097	3,818,855.80	3.01
11	Alibaba Group Holding Ltd	US01609W1027	3,761,016.12	2.97
12	TAL Education Group	US8740801043	3,745,879.34	2.96
13	ENN Energy Holdings Ltd	KYG3066L1014	3,557,743.83	2.81
14	China Everbright Bank Co Ltd	CNE100001QW3	3,532,900.62	2.79
15	New Oriental Education & Technology Group Inc	US6475811070	3,378,999.12	2.67
16	China Xinhua Education Group Ltd	KYG216231061	3,311,756.41	2.61
17	Huazhu Group Ltd	US44332N1063	3,130,061.24	2.47
18	China Evergrande Group	KYG2119W1069	3,083,533.98	2.43
19	CITIC Securities Co Ltd	CNE1000016V2	2,970,148.95	2.34
20	China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	HK0000056256	2,906,829.68	2.29
21	Kingdee International Software Group Co Ltd	KYG525681477	2,871,668.63	2.27
22	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	CNE1000004X4	2,802,814.47	2.21
23	China Gas Holdings Ltd	BMG2109G1033	2,614,055.14	2.06
24	Sino Biopharmaceutical Ltd	KYG8167W1380	2,569,055.26	2.03

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	73,459,086.51
卖出收入（成交）总额	137,888,197.46

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	453,249.40
3	应收股利	493,630.34
4	应收利息	262.23



5	应收申购款	130,488.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,077,630.74

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
14,745	4,254.87	0.00	0.00%	62,738,111.66	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,444,985.95	2.30%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月9日）基金份额总额	243,722,985.20
本报告期期初基金份额总额	119,535,094.45
本报告期期间基金总申购份额	13,794,152.79
减：本报告期期间基金总赎回份额	70,591,135.58
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	62,738,111.66

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

基金管理人于2019年5月8日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，尚军先生自2019年5月6日起不再担任董事长。

基金管理人于2019年5月9日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告》，郭特华女士自2019年5月8日起担任董事长，不再担任总经理；王海璐女士自2019年5月8日起担任总经理。

#### 2、基金托管人：

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人收到中国人民银行营业管理部处罚决定，对公司未严格按照反洗钱相关规定履行客户身份识别义务及可疑交易报告义务予以罚款。基金管理人对此高度重视，积极开展整改工作，已完善了反洗钱制度体系和工作机制，深入具体问题整改。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
大和资本	-	190,505,071.10	90.25%	80,853.01	73.59%	-
高盛	-	16,841,752.78	7.98%	25,262.63	22.99%	-
招商证券	-	3,746,627.70	1.77%	3,746.64	3.41%	-
花旗	-	-	-	-	-	-
中金香港	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
里昂证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信国际	-	-	-	-	-	-
建银国际	-	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序：为保障公司境外证券投资的顺利开展，基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券经营机构，向其租用专用交易单元。

## (1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及量化、衍生品和国际市场的研究服务支持。
- c) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。
- d) 与其他证券经营机构相比，能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金费率。

## (2) 选择程序

- a) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。
- b) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立账户事宜，并通知基金托管人。

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加国信证券基金申购、定投手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年3月5日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年3月29日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年4月1日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2019年4月1日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于增加玄元保险代理有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2019年4月3日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019年5月8日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019年5月9日
8	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金2019年开放日的提示性公告	中国证监会指定的媒介	2019年6月12日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190110	49,629,625.00	-	49,629,625.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中，存在基金规模大幅波动的风险，以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)