

工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 8 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 3 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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 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	61
8.7 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	61
8.8 报告期末按公允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	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.3 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情况	63
§ 10 开放式基金份额变动	63
§ 11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
12.1 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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金
基金简称	工银中小盘混合
基金主代码	481010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 10 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	193,958,579.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资高成长性的中小市值股票，追求基金资产长期稳定的增值和收益，在有效控制风险的前提下，力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
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。股票资产主要投资于中小盘股票，投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产占股票投资资产的比例不低于 80%。本基金将首先采用定量分析指标，筛选出成长潜力较大的中小市值上市公司。基于对公司未来业绩发展的预测，采用股息贴现模型、自由现金流折现模型等方法评估公司股票的合理内在价值，同时结合股票的市场价格，考虑市盈率、市净率等相对估值指标，选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。
业绩比较基准	80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。
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债券型基金，低于股票型基金。本基金主要投资于中小盘股票，在混合型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	贺倩
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbcs.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-68121816
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、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	甲 5 号 9 层甲 5 号 901	
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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王海璐	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	基金管理人或基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
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、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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	74,525,292.95	-33,907,326.60	3,937,136.16
本期利润	111,514,252.68	-57,913,095.74	-40,088,438.23
加权平均基金份额本期利润	0.4901	-0.3348	-0.1726
本期加权平均净值利润率	36.83%	-28.70%	-12.56%
本期基金份额净值增长率	61.21%	-25.89%	-11.49%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	105,846,039.52	-7,223,238.14	50,343,192.71
期末可供分配基金	0.5457	-0.0408	0.2942

份额利润			
期末基金资产净值	299,804,619.26	169,676,270.91	221,468,995.41
期末基金份额净值	1.546	0.959	1.294
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	54.60%	-4.10%	29.40%

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或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2010 年 02 月 10 日。

3.2 基金净值表现

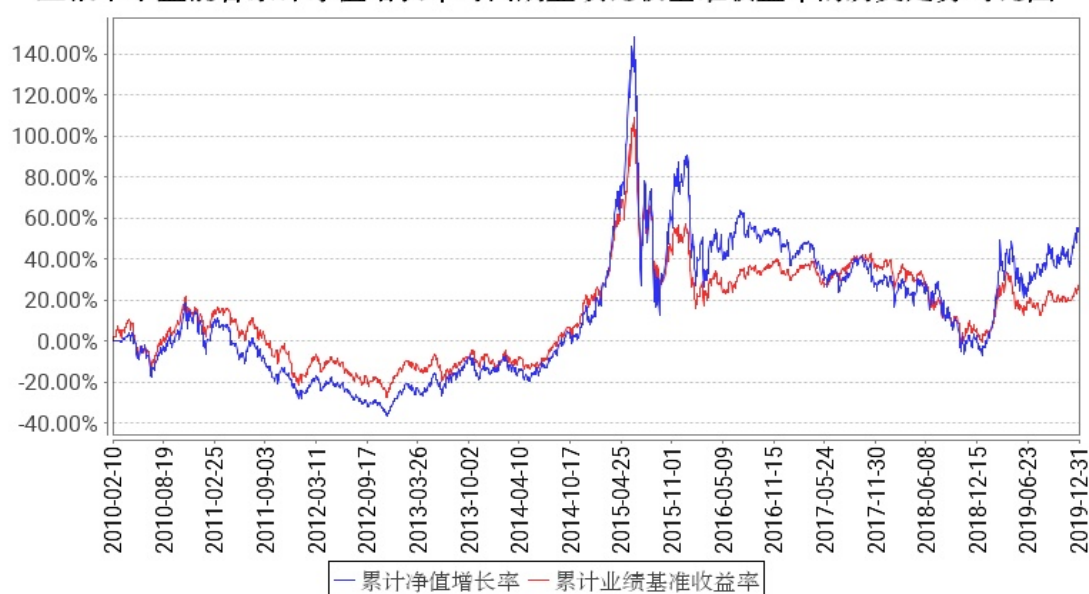
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.93%	1.41%	7.07%	0.70%	5.86%	0.71%
过去六个月	20.88%	1.43%	7.66%	0.82%	13.22%	0.61%
过去一年	61.21%	1.83%	26.22%	1.13%	34.99%	0.70%
过去三年	5.75%	1.54%	-3.92%	1.02%	9.67%	0.52%
过去五年	42.36%	2.09%	6.80%	1.43%	35.56%	0.66%

自基金合同生效起至今	54.60%	1.74%	27.33%	1.31%	27.27%	0.43%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

工银中小盘混合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

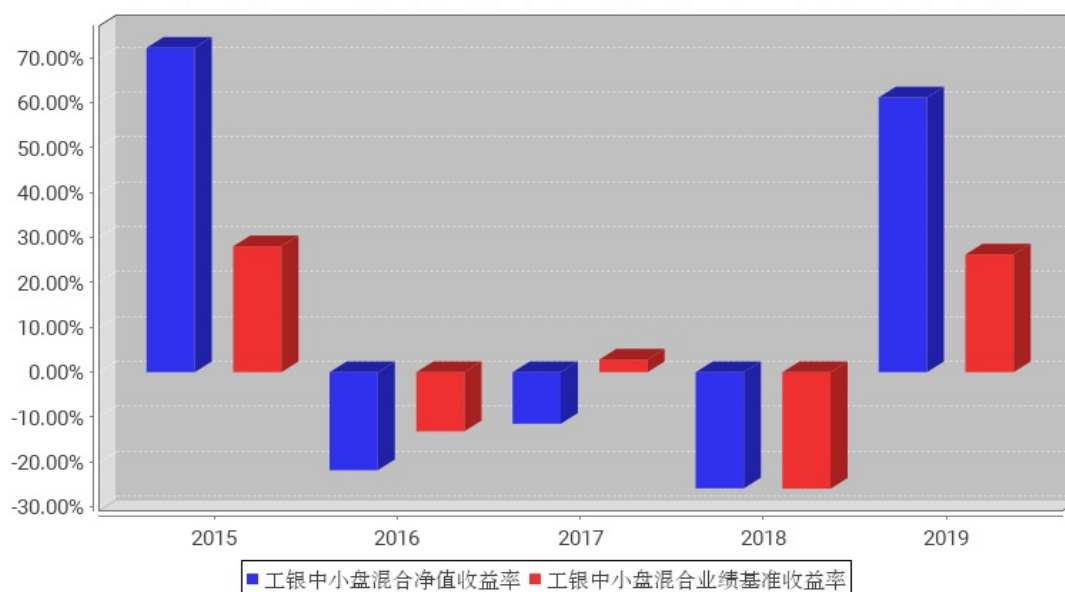


注:1、本基金基金合同于 2010 年 2 月 10 日生效。

2、根据基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至本报告期末,本基金的投资符合基金合同的规定:本基金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%。本基金持有的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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的股票资产主要投资于中小盘股票,投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产占股票投资资产的比例不低于 80%。

3.2.3 过去五年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

工银中小盘混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、私募资产管理计划、企业年金、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金养老产品、职业年金等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

截至 2019 年 12 月 31 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）、工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金等逾 140 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		
黄安乐	权益投资总监，本基金的基金经理	2018 年 3 月 28 日	—	16	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010 年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2011 年 11 月 23 日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2013 年 9 月 23 日至 2019 年 2 月 13 日，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014 年 10 月 22 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；2015 年 4 月 28 日至 2018 年 3 月 2 日，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理；2016 年 1 月 29 日至 2018 年

					11 月 30 日,担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理; 2017 年 4 月 21 日至 2019 年 1 月 24 日,担任工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金经理; 2018 年 3 月 28 日至今,担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 6 月 5 日至今,担任工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金基金经理。
农冰立	本基金的基金经理	2018 年 6 月 22 日	2019 年 8 月 14 日	5	先后在泰达宏利基金担任 TMT 行业研究员,在天风证券担任电子行业首席分析师; 2017 年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任研究部电子、通信行业研究员、基金经理, 2018 年 6 月 22 日至 2019 年 8 月 14 日,担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 6 月 22 日至今,担任工银瑞信智能制造股票型证券投资基金基金经理。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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，制定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类投资组合的公平对待做了明确具体的规定，办法涵盖了公平交易的原则、适用范围、部门职责、具体程序和违规问责等。

在研究和投资决策环节，研究人员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等建立投资备选池，投资人员在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合，并确保公平对待其管理的不同投资组合。

在交易执行环节，交易人员根据公司内部权限管理规定获得权限，并遵循价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施等执行原则，保证交易在不同投资组合间的利益公平。

同时本基金管理人在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于满足条件的指令，系统自动通过公平交易模块执行。

在监控和检查环节，风险管理人员对交易价格公允性等进行监控和分析，监察稽核人员定期对公平交易执行情况进行稽核。发现异常情况的，要求投资人员进行解释说明并核查其真实性、合理性。

本基金管理人通过上述措施全面落实公平交易要求，并持续地完善公平交易制度，确保公平对待各类投资人，保护投资人的利益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本基金管理人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。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 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9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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年，本基金坚持在中小盘板块中进行行业配置和选股。总体上，市场风格有利于中小盘资产，2019 年中小板指数和创业板指数表现突出，优于大盘蓝筹类指数。在行业层面，农林牧渔，电子，计算机，通信，电力设备和创新药的涨幅很大，也为中小盘资产的投资提供了大量的选择机会。

2018 年底，我们预判，在非洲猪瘟扩散之下，国内猪肉将出现供给短缺，价格有大幅上涨的可能，同时也将带动其他动物蛋白的价格上涨，本基金超配了农林牧渔板块；此外，我们也看到，2018 年国内光伏政策的变化，使得行业存在业绩增长和估值的修复的双重拉动，本基金在光伏板块也进行了重仓配置。2019 年上半年，在农林牧渔和光伏行业的超配为基金组合带来了较高的投资回报率。下半年本基金降低了农林牧渔和光伏板块的配置仓位，增加半导体，消费电子以及创新药 CXO，部分必需消费品等板块的配置，这些新增配置获得的投资收益，抵消了因农林牧渔和光伏板块下跌的损失，使得下半年的组合投资收益率有所回升。全年来看，本基金的组合投资获得了一定幅度的超额收益和绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 61.21%，业绩比较基准收益率为 26.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，我国宏观经济依然存在向下的压力，尤其新型冠状病毒引发的肺炎疫情快速传播，影响到人员、物资甚至是资金的顺利流转，对我国经济增长带来了巨大的冲击，这一事件构成 A 股市场波动最大动因，而且其中长期的影响现在还难以准确评估，随着疫情的升级，对海外需求下滑的担忧与日俱增，国内嵌入全球产业链的行业，短期展望的不确定性大幅上升。如果疫情在 2 季度还得不到有效遏制，那么全球经济有可能出现一定时间的“停摆”，就国内而言，全年的经济增长将会面临比较大的压力。与此对应，我们预期，稳增长的宏观政策力度会随着对疫情影响的评估而调整，政策环境趋于宽松；在全球大规模释放流动性，且因经济活动中断导致部分物资供给受限的条件下，2020 年的 CPI 走势可能会发生超预期的演变，我们担心下半年的通胀上行风险。疫情导致的全球宏观经济层面的负面冲击，是 2020 年 A 股市场投资需要面对的复杂局面之一。

在估值层面，2020 年虽然不再具备 2019 年初各类板块极低的估值分位数水平，但随着市场因疫情而下跌，大多数行业的估值下降到历史 20-30% 的分位数，整体并未存在泡沫或者过度高估

的情况。企业盈利方面，整体水平预期要下滑，只有极少部分行业，得益于结构性的景气以及短期的补库存行为，存在结构性的盈利回升；与此同时，我们也注意到，在疫情冲击之下，不少行业的景气和补库存受到冲击，至少会影响一季度的业绩增长，同时二季度业绩增长的展望不确定性增加；而因为需求的消失，部分行业受到的影响则可能会更长久。从增量资金来看，由于流动性的要求，外资资金短期有流出的趋势；国内而言，政策一贯支持鼓励长期资金进入权益市场，短期来看，市场流动性存在对冲的现象。

总体来看，2020 年 A 股市场，因肺炎疫情的演变，存在较大的不确定性；市场需要持续评估全球经济所遭受的创伤，并随着疫情防控效果的变化而不断修正各种预期；这决定了市场处在动荡不稳定状态。但我们也认为，在市场恐慌性下跌的过程中，股票估值相应地对短期逻辑及部分中线逻辑进行了修正甚至过度修正，使得基于中长线逻辑的投资迎来布局的机会；另外全球产业链的破坏，反过来凸显出以内需为主的行业和板块相对稳健的基本面优势，这是在行业配置层面尤其需要考量的。

面对复杂多变的市場，基于基本面趋势的判断，我们关注以下几个方面的投资机会：一是刚性内需板块，包括医药，食品，农业等行业，这类行业在当前外需下滑和增长不确定性提高的环境下，基本面具备相对优势；二是大幅下跌之后，部分行业的低估值龙头，配置价值显现，这类公司出现在工程机械，光伏，锂电池，消费电子，基础化工等行业之中；第三，经历大幅度估值调整，但中长线投资逻辑及产业演变趋势不变的部分科技板块。我们认为，科技股仍将以 5G 和半导体为主战场。5G 网络投资和发展引发各类产业链和生态演变，蕴藏着大量投资机会，如 5G 手机换机潮拉动的消费电子板块的增长，5G 网络普及引起的各种可能的应用场景，目前可看到的领域是视频，游戏，AR/VR，自动驾驶，线上办公，云计算等。半导体在中国仍处在高速发展期，在封测，半导体设备，半导体材料方面的成长空间依然巨大，而部分商用的芯片领域，中国的企业也在逐步提升技术水平和行业地位，获得收入和利润的增长。此外，计算机软件方面的国产替代，也是一个值得关注的产业趋势。我们有一定的机会，在上述科技方向上精选估值合理未来价值增长空间足够的优质中小盘成长股进行配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守

法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

（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。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

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、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

本报告期内，本基金未实施利润分配，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 60802052_A10 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的

	事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2020年4月7日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	16,403,744.91	21,302,819.89
结算备付金		2,603,767.34	504,603.07
存出保证金		230,785.89	110,535.07
交易性金融资产	7.4.7.2	281,964,024.85	150,194,804.42
其中：股票投资		281,964,024.85	150,194,804.42
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,928,645.33	-
应收利息	7.4.7.5	5,288.92	5,134.02
应收股利		-	-
应收申购款		1,302,619.44	33,147.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		309,438,876.68	172,151,043.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,548,614.52	1,710,088.26
应付赎回款		1,567,458.92	36,278.67
应付管理人报酬		380,933.93	223,583.41
应付托管费		63,488.99	37,263.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	873,021.01	238,934.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	200,740.05	228,623.86
负债合计		9,634,257.42	2,474,772.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	193,958,579.74	176,899,509.05
未分配利润	7.4.7.10	105,846,039.52	-7,223,238.14
所有者权益合计		299,804,619.26	169,676,270.91
负债和所有者权益总计		309,438,876.68	172,151,043.63

注：1、本基金基金合同生效日为 2010 年 2 月 10 日。2、报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.546 元，基金份额总额为 193,958,579.74 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		122,050,535.83	-52,341,302.95
1. 利息收入		206,802.42	208,450.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	192,407.06	193,564.95
债券利息收入		-	90.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,395.36	14,794.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		84,140,164.84	-28,642,447.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	82,287,445.82	-30,095,408.18
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	8,541.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,852,719.02	1,444,419.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	36,988,959.73	-24,005,769.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	714,608.84	98,462.95
减: 二、费用		10,536,283.15	5,571,792.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,510,649.51	3,023,438.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	751,774.93	503,906.41
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,080,502.46	1,823,685.65
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.31
7. 其他费用	7.4.7.20	193,356.25	220,761.96
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		111,514,252.68	-57,913,095.74
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		111,514,252.68	-57,913,095.74

注:本基金基金合同生效日为 2010 年 02 月 10 日。

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	176,899,509.05	-7,223,238.14	169,676,270.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	111,514,252.68	111,514,252.68
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)	17,059,070.69	1,555,024.98	18,614,095.67
其中: 1. 基金申购款	297,998,521.49	105,286,111.65	403,284,633.14
2. 基金赎回款	-280,939,450.80	-103,731,086.67	-384,670,537.47

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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	193,958,579.74	105,846,039.52	299,804,619.26
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	171,125,802.70	50,343,192.71	221,468,995.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-57,913,095.74	-57,913,095.74
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）	5,773,706.35	346,664.89	6,120,371.24
其中：1. 基金申购款	45,356,989.95	9,319,762.26	54,676,752.21
2. 基金赎回款	-39,583,283.60	-8,973,097.37	-48,556,380.97
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	176,899,509.05	-7,223,238.14	169,676,270.91

注：本基金基金合同生效日为 2010 年 02 月 10 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王海璐

赵紫英

关亚君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）（原名“工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1472号《关于核准工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2010年2月10日正式生效，首次设立募集规模为2,317,605,629.49份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、中央银行票据、回购，以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具，其中，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%，本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的股票资产主要投资于中小盘股票，投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产占股票投资资产的比例不低于80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证700指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信

息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发

行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式，投资人可选择获取现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 本基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 在符合上述基金收益分配的前提下，本基金每年收益分配至多四次，每次基金收益分配比例不得低于可供分配利润的 50%；

(5) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股

票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	16,403,744.91	21,302,819.89
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	16,403,744.91	21,302,819.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	251,105,414.94	281,964,024.85	30,858,609.91
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	251,105,414.94	281,964,024.85	30,858,609.91
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	156,325,154.24	150,194,804.42	-6,130,349.82
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	156,325,154.24	150,194,804.42	-6,130,349.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,885.87	4,829.54

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	1,288.87	249.81
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	114.18	54.67
合计	5,288.92	5,134.02

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	873,021.01	238,934.61
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	873,021.01	238,934.61

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,240.05	123.86
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	150,000.00
预提账户维护费	4,500.00	4,500.00
应缴债券利息税	24,000.00	24,000.00
合计	200,740.05	228,623.86

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,899,509.05	176,899,509.05
本期申购	297,998,521.49	297,998,521.49
本期赎回（以“-”号填列）	-280,939,450.80	-280,939,450.80
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	193,958,579.74	193,958,579.74

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 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	103,027,386.26	-110,250,624.40	-7,223,238.14
本期利润	74,525,292.95	36,988,959.73	111,514,252.68
本期基金份额交易产生的变动数	822,707.13	732,317.85	1,555,024.98
其中：基金申购款	196,122,996.59	-90,836,884.94	105,286,111.65
基金赎回款	-195,300,289.46	91,569,202.79	-103,731,086.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	178,375,386.34	-72,529,346.82	105,846,039.52

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	163,596.06	181,005.07
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	26,080.96	10,817.72
其他	2,730.04	1,742.16
合计	192,407.06	193,564.95

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	2,017,650,597.87	701,528,951.58
减：卖出股票成本总额	1,935,363,152.05	731,624,359.76
买卖股票差价收入	82,287,445.82	-30,095,408.18

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	-	8,541.40
债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	-	8,541.40

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成交总额	-	165,635.00
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	-	157,000.00
减：应收利息总额	-	93.60
买卖债券差价收入	-	8,541.40

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,852,719.02	1,444,419.68
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	1,852,719.02	1,444,419.68

7.4.7.17 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	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018
------	------------------------------	---------------------------------

	12 月 31 日	年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	36,988,959.73	-24,005,769.14
股票投资	36,988,959.73	-24,005,769.14
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	36,988,959.73	-24,005,769.14

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	562,867.19	78,062.76
基金转换费收入	151,741.65	20,400.19
合计	714,608.84	98,462.95

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	5,080,502.46	1,823,685.65
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,080,502.46	1,823,685.65

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	150,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	5,356.25	2,761.96
合计	193,356.25	220,761.96

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司	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
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,510,649.51	3,023,438.46
其中：支付销售机构的客户维护费	1,306,719.64	858,226.68

注：1、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

本基金年管理费率为 1.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	751,774.93	503,906.41

注：1、在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	16,403,744.91	163,596.06	21,302,819.89	181,005.07

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2019年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688198	佰仁医疗	2019年11月29日	2020年6月9日	新股锁定	23.68	37.58	3,213	76,083.84	120,744.54	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019年12月31日	重大事项	39.39	2020年1月2日	40.43	128,000	3,622,817.93	5,041,920.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	16,403,744.91	-	-	-	-	-	16,403,744.91
结算备付金	2,603,767.34	-	-	-	-	-	2,603,767.34
存出保证金	230,785.89	-	-	-	-	-	230,785.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	281,964,024.85	281,964,024.85
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-	-	6,928,645	6,928,645

款						. 33	33
应收利息	-	-	-	-	-	5, 288. 92	5, 288. 92
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1, 302, 619 . 44	1, 302, 619. 44
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19, 238, 298. 14	-	-	-	-	290, 200, 578. 54	309, 438, 876. 68
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6, 548, 614 . 52	6, 548, 614. 52
应付赎回款	-	-	-	-	-	1, 567, 458 . 92	1, 567, 458. 92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	380, 933. 93	380, 933. 93
应付托管费	-	-	-	-	-	63, 488. 99	63, 488. 99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	873, 021. 01	873, 021. 01
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	200, 740. 05	200, 740. 05
负债总计	-	-	-	-	-	9, 634, 257 . 42	9, 634, 257. 42
利率敏感度缺口	19, 238, 298. 14	-	-	-	-	280, 566, 321. 12	299, 804, 619. 26
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	21, 302, 819.	-	-	-	-	-	21, 302, 819

	89						. 89
结算备付金	504, 603. 07	-	-	-	-	-	504, 603. 07
存出保证金	110, 535. 07	-	-	-	-	-	110, 535. 07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	150, 194, 804. 42	150, 194, 804. 42
应收利息	-	-	-	-	-	5, 134. 02	5, 134. 02
应收申购款	-	-	-	-	-	33, 147. 16	33, 147. 16
资产总计	21, 917, 958. 03	-	-	-	-	150, 233, 085. 60	172, 151, 043. 63
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1, 710, 088. 26	1, 710, 088. 26
应付赎回款	-	-	-	-	-	36, 278. 67	36, 278. 67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	223, 583. 41	223, 583. 41
应付托管费	-	-	-	-	-	37, 263. 91	37, 263. 91
应付交易费用	-	-	-	-	-	238, 934. 61	238, 934. 61
其他负债	-	-	-	-	-	228, 623. 86	228, 623. 86
负债总计	-	-	-	-	-	2, 474, 772. 72	2, 474, 772. 72
利率敏感度缺口	21, 917, 958. 03	-	-	-	-	147, 758, 312. 88	169, 676, 270. 91

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

无。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	281,964,024.85	94.05	150,194,804.42	88.52
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	281,964,024.85	94.05	150,194,804.42	88.52

注：1、基金的投资组合比例为：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%。

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。

7.4.13.4.3.2 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）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	18,670,077.22	10,627,350.03
分析	业绩比较基准减少 5%	-18,670,077.22	-10,627,350.03

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 276,794,782.27 元，属于第二层次的余额为人民币 5,048,498.04 元，属于第三层次的余额为人民币 120,744.54 元。（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 150,194,804.42 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政

策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	281,964,024.85	91.12
	其中：股票	281,964,024.85	91.12
2	基金投资	—	—
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	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	19,007,512.25	6.14
8	其他各项资产	8,467,339.58	2.74
9	合计	309,438,876.68	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	—	—
B	采矿业	9,804,800.00	3.27
C	制造业	202,783,626.81	67.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,990,620.00	12.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,739,200.00	1.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,431,200.00	4.81
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,208,000.00	5.07
S	综合	-	-
	合计	281,964,024.85	94.05

注：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。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	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	300136	信维通信	368,000	16,699,840.00	5.57
2	300759	康龙化成	280,000	14,431,200.00	4.81
3	002624	完美世界	288,000	12,712,320.00	4.24
4	603659	璞泰来	138,000	11,750,700.00	3.92
5	002812	恩捷股份	230,060	11,618,030.00	3.88
6	002138	顺络电子	488,000	11,272,800.00	3.76
7	002555	三七互娱	418,000	11,256,740.00	3.75
8	300450	先导智能	250,037	11,236,662.78	3.75
9	300413	芒果超媒	300,000	10,488,000.00	3.50
10	300037	新宙邦	288,000	10,465,920.00	3.49
11	000951	中国重汽	400,020	9,000,450.00	3.00
12	603986	兆易创新	40,000	8,195,600.00	2.73
13	002353	杰瑞股份	193,229	7,141,743.84	2.38
14	601012	隆基股份	279,700	6,944,951.00	2.32
15	300014	亿纬锂能	130,000	6,520,800.00	2.18
16	000425	徐工机械	1,180,000	6,454,600.00	2.15
17	002233	塔牌集团	499,993	6,299,911.80	2.10

18	000401	冀东水泥	368,000	6,259,680.00	2.09
19	688021	奥福环保	160,000	5,809,600.00	1.94
20	300630	普利制药	100,000	5,664,000.00	1.89
21	603993	洛阳钼业	1,280,000	5,580,800.00	1.86
22	002460	赣锋锂业	160,000	5,572,800.00	1.86
23	600801	华新水泥	210,000	5,550,300.00	1.85
24	000977	浪潮信息	180,000	5,418,000.00	1.81
25	600031	三一重工	300,000	5,115,000.00	1.71
26	603799	华友钴业	128,000	5,041,920.00	1.68
27	600426	华鲁恒升	250,000	4,967,500.00	1.66
28	300251	光线传媒	400,000	4,720,000.00	1.57
29	002174	游族网络	200,000	4,654,000.00	1.55
30	002601	龙蟠佰利	300,000	4,617,000.00	1.54
31	002368	太极股份	118,000	4,592,560.00	1.53
32	601808	中海油服	220,000	4,224,000.00	1.41
33	300274	阳光电源	400,600	4,218,318.00	1.41
34	600438	通威股份	300,000	3,939,000.00	1.31
35	000069	华侨城 A	480,000	3,739,200.00	1.25
36	300618	寒锐钴业	44,800	3,691,072.00	1.23
37	600584	长电科技	150,000	3,297,000.00	1.10
38	002156	通富微电	200,000	3,290,000.00	1.10
39	300379	东方通	60,000	2,775,000.00	0.93
40	002371	北方华创	30,000	2,640,000.00	0.88
41	688012	中微公司	28,045	2,591,358.00	0.86
42	002185	华天科技	149,500	1,116,765.00	0.37
43	688037	芯源微	3,028	221,922.12	0.07
44	688198	佰仁医疗	3,213	120,744.54	0.04
45	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
46	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
47	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002299	圣农发展	61,805,806.08	36.43
2	300498	温氏股份	54,000,708.74	31.83
3	002714	牧原股份	49,460,299.15	29.15
4	002458	益生股份	43,754,410.82	25.79
5	600183	生益科技	37,548,002.08	22.13
6	000876	新希望	33,904,914.61	19.98
7	300014	亿纬锂能	30,925,069.96	18.23

8	002138	顺络电子	30,000,642.29	17.68
9	603986	兆易创新	29,750,675.04	17.53
10	300450	先导智能	29,197,308.38	17.21
11	002234	民和股份	28,912,759.60	17.04
12	002643	万润股份	27,705,885.38	16.33
13	000977	浪潮信息	26,594,442.20	15.67
14	300136	信维通信	25,842,247.00	15.23
15	002191	劲嘉股份	23,891,381.63	14.08
16	300059	东方财富	23,821,184.99	14.04
17	300274	阳光电源	22,782,882.54	13.43
18	603659	璞泰来	21,707,098.28	12.79
19	600975	新五丰	21,604,838.80	12.73
20	601012	隆基股份	21,454,589.03	12.64
21	603899	晨光文具	21,109,321.77	12.44
22	300782	卓胜微	21,004,719.12	12.38
23	603228	景旺电子	19,503,085.60	11.49
24	600872	中炬高新	18,304,962.54	10.79
25	603363	傲农生物	17,527,459.00	10.33
26	300761	立华股份	17,432,384.85	10.27
27	603605	珀莱雅	17,397,560.00	10.25
28	300285	国瓷材料	17,272,461.02	10.18
29	002157	正邦科技	17,228,058.77	10.15
30	002508	老板电器	17,209,366.93	10.14
31	300630	普利制药	16,813,323.76	9.91
32	600438	通威股份	15,743,166.88	9.28
33	300037	新宙邦	15,729,390.00	9.27
34	002371	北方华创	15,549,545.00	9.16
35	002124	天邦股份	15,070,021.83	8.88
36	002555	三七互娱	14,956,366.41	8.81
37	002938	鹏鼎控股	14,559,096.00	8.58
38	000636	风华高科	14,235,031.45	8.39
39	601688	华泰证券	13,713,125.12	8.08
40	002548	金新农	13,554,717.12	7.99
41	002439	启明星辰	13,530,880.87	7.97
42	300759	康龙化成	13,450,604.48	7.93
43	688029	南微医学	12,626,421.91	7.44
44	600763	通策医疗	12,617,413.00	7.44
45	300657	弘信电子	12,363,883.30	7.29
46	002812	恩捷股份	12,295,855.40	7.25
47	600584	长电科技	12,182,296.00	7.18
48	603317	天味食品	11,942,298.76	7.04
49	002415	海康威视	11,926,605.87	7.03

50	600745	闻泰科技	11,801,664.98	6.96
51	603799	华友钴业	11,791,690.18	6.95
52	002690	美亚光电	11,759,887.30	6.93
53	300316	晶盛机电	11,704,138.52	6.90
54	002233	塔牌集团	11,386,283.79	6.71
55	002624	完美世界	11,224,931.97	6.62
56	300496	中科创达	11,210,872.00	6.61
57	300207	欣旺达	11,182,584.11	6.59
58	300413	芒果超媒	10,897,257.60	6.42
59	600588	用友网络	10,767,454.99	6.35
60	002372	伟星新材	10,755,680.64	6.34
61	002815	崇达技术	10,744,007.66	6.33
62	002185	华天科技	10,683,497.00	6.30
63	002230	科大讯飞	10,451,947.50	6.16
64	002582	好想你	10,335,045.08	6.09
65	300463	迈克生物	10,331,336.82	6.09
66	000425	徐工机械	10,146,284.00	5.98
67	300251	光线传媒	9,997,541.92	5.89
68	603983	丸美股份	9,738,905.68	5.74
69	002567	唐人神	9,619,590.29	5.67
70	600570	恒生电子	9,538,003.00	5.62
71	002271	东方雨虹	9,476,618.64	5.59
72	600600	青岛啤酒	9,186,973.00	5.41
73	000002	万 科 A	9,164,589.20	5.40
74	002311	海大集团	9,059,306.38	5.34
75	002174	游族网络	8,894,418.53	5.24
76	603186	华正新材	8,799,116.00	5.19
77	002916	深南电路	8,765,071.31	5.17
78	002008	大族激光	8,753,317.00	5.16
79	300618	寒锐钴业	8,700,849.97	5.13
80	688012	中微公司	8,621,300.45	5.08
81	000951	中国重汽	8,354,946.35	4.92
82	002100	天康生物	8,340,698.96	4.92
83	002746	仙坛股份	8,248,469.30	4.86
84	300446	乐凯新材	7,448,094.84	4.39
85	600585	海螺水泥	7,388,753.31	4.35
86	002385	大北农	7,236,971.00	4.27
87	002920	德赛西威	7,130,446.00	4.20
88	002216	三全食品	7,086,937.68	4.18
89	002405	四维图新	7,025,461.96	4.14
90	603118	共进股份	6,926,288.40	4.08
91	300760	迈瑞医疗	6,907,536.00	4.07

92	002353	杰瑞股份	6,862,217.56	4.04
93	603583	捷昌驱动	6,854,011.50	4.04
94	002099	海翔药业	6,749,756.76	3.98
95	603658	安图生物	6,735,065.00	3.97
96	603345	安井食品	6,720,435.46	3.96
97	603517	绝味食品	6,663,271.80	3.93
98	600132	重庆啤酒	6,624,245.06	3.90
99	300747	锐科激光	6,522,737.00	3.84
100	000100	TCL 集团	6,520,490.00	3.84
101	002156	通富微电	6,436,671.80	3.79
102	002460	赣锋锂业	6,330,856.00	3.73
103	300575	中旗股份	6,266,888.00	3.69
104	601678	滨化股份	6,236,113.13	3.68
105	300134	大富科技	6,233,218.00	3.67
106	002396	星网锐捷	6,210,792.41	3.66
107	002821	凯莱英	6,198,131.00	3.65
108	002912	中新赛克	6,112,713.46	3.60
109	300613	富瀚微	6,093,885.00	3.59
110	300474	景嘉微	6,092,746.00	3.59
111	300529	健帆生物	6,077,041.91	3.58
112	300253	卫宁健康	5,996,089.00	3.53
113	002049	紫光国微	5,982,090.00	3.53
114	002384	东山精密	5,912,432.50	3.48
115	300357	我武生物	5,903,649.42	3.48
116	603127	昭衍新药	5,902,829.60	3.48
117	300639	凯普生物	5,845,836.43	3.45
118	002241	歌尔股份	5,836,751.00	3.44
119	300628	亿联网络	5,783,453.04	3.41
120	000671	阳光城	5,780,765.36	3.41
121	300482	万孚生物	5,776,312.20	3.40
122	000401	冀东水泥	5,771,750.42	3.40
123	300558	贝达药业	5,720,512.00	3.37
124	300595	欧普康视	5,599,404.99	3.30
125	603515	欧普照明	5,577,845.00	3.29
126	603993	洛阳钼业	5,571,128.00	3.28
127	002466	天齐锂业	5,552,830.00	3.27
128	000895	双汇发展	5,418,313.00	3.19
129	603806	福斯特	5,304,949.64	3.13
130	300166	东方国信	5,175,121.00	3.05
131	002409	雅克科技	5,168,753.00	3.05
132	603708	家家悦	5,135,894.60	3.03
133	000069	华侨城 A	5,122,602.00	3.02

134	600703	三安光电	5,050,430.00	2.98
135	688021	奥福环保	5,010,531.62	2.95
136	600031	三一重工	5,009,918.00	2.95
137	601066	中信建投	4,985,001.12	2.94
138	688008	澜起科技	4,981,197.31	2.94
139	600426	华鲁恒升	4,932,336.00	2.91
140	600801	华新水泥	4,915,455.20	2.90
141	300396	迪瑞医疗	4,877,719.00	2.87
142	600563	法拉电子	4,872,686.00	2.87
143	002368	太极股份	4,819,551.00	2.84
144	002675	东诚药业	4,808,691.00	2.83
145	002273	水晶光电	4,805,983.50	2.83
146	002129	中环股份	4,684,450.00	2.76
147	600195	中牧股份	4,626,059.80	2.73
148	300679	电连技术	4,589,444.65	2.70
149	601689	拓普集团	4,566,736.24	2.69
150	300124	汇川技术	4,546,015.00	2.68
151	002601	龙麟佰利	4,459,714.00	2.63
152	603678	火炬电子	4,279,104.00	2.52
153	600176	中国巨石	4,258,461.25	2.51
154	600298	安琪酵母	4,195,747.00	2.47
155	601808	中海油服	4,119,370.00	2.43
156	300024	机器人	4,068,643.34	2.40
157	300315	掌趣科技	4,068,336.00	2.40
158	603959	百利科技	4,036,143.60	2.38
159	300188	美亚柏科	4,034,197.15	2.38
160	603609	禾丰牧业	3,993,656.73	2.35
161	300577	开润股份	3,983,596.00	2.35
162	300662	科锐国际	3,670,104.00	2.16
163	300406	九强生物	3,636,634.96	2.14
164	300685	艾德生物	3,616,395.10	2.13
165	002568	百润股份	3,565,976.00	2.10
166	600048	保利地产	3,561,065.00	2.10
167	603232	格尔软件	3,557,915.20	2.10
168	300340	科恒股份	3,532,207.40	2.08
169	300638	广和通	3,511,665.00	2.07
170	603039	泛微网络	3,502,610.00	2.06
171	300443	金雷股份	3,476,953.00	2.05
172	300548	博创科技	3,475,604.00	2.05
173	603236	移远通信	3,469,766.60	2.04
174	603711	香飘飘	3,437,909.08	2.03

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	68,957,217.14	40.64
2	002714	牧原股份	67,327,557.51	39.68
3	002299	圣农发展	57,579,635.41	33.93
4	002458	益生股份	42,344,239.14	24.96
5	002157	正邦科技	42,281,448.49	24.92
6	300014	亿纬锂能	36,331,850.32	21.41
7	300450	先导智能	36,319,548.66	21.41
8	000876	新希望	36,217,483.43	21.35
9	600183	生益科技	35,944,537.34	21.18
10	600872	中炬高新	30,604,197.57	18.04
11	601012	隆基股份	28,453,542.86	16.77
12	002234	民和股份	28,021,110.20	16.51
13	002643	万润股份	26,138,229.43	15.40
14	300285	国瓷材料	26,114,631.80	15.39
15	300782	卓胜微	26,046,353.60	15.35
16	300274	阳光电源	25,700,350.00	15.15
17	600438	通威股份	24,783,674.90	14.61
18	603986	兆易创新	23,765,778.33	14.01
19	300059	东方财富	23,606,335.60	13.91
20	603899	晨光文具	21,977,715.16	12.95
21	600975	新五丰	21,844,232.10	12.87
22	000977	浪潮信息	21,803,204.92	12.85
23	002124	天邦股份	21,412,320.00	12.62
24	002191	劲嘉股份	20,289,429.38	11.96
25	002138	顺络电子	20,282,406.90	11.95
26	603363	傲农生物	19,572,444.23	11.54
27	300761	立华股份	17,853,249.30	10.52
28	603228	景旺电子	17,779,325.56	10.48
29	002311	海大集团	17,496,561.91	10.31
30	002508	老板电器	17,235,262.36	10.16
31	603605	珀莱雅	16,877,974.00	9.95
32	600745	闻泰科技	16,787,406.00	9.89
33	300136	信维通信	16,582,048.58	9.77
34	002548	金新农	15,138,889.78	8.92
35	300657	弘信电子	14,767,992.40	8.70

36	601688	华泰证券	14,156,848.04	8.34
37	002371	北方华创	13,705,223.00	8.08
38	000636	风华高科	13,609,199.00	8.02
39	002439	启明星辰	13,444,070.00	7.92
40	300037	新宙邦	13,161,910.00	7.76
41	002567	唐人神	13,065,870.00	7.70
42	600763	通策医疗	12,777,944.00	7.53
43	300630	普利制药	12,515,282.00	7.38
44	688029	南微医学	12,502,006.77	7.37
45	002938	鹏鼎控股	12,218,491.85	7.20
46	002690	美亚光电	12,034,833.40	7.09
47	300750	宁德时代	11,776,259.22	6.94
48	002415	海康威视	11,768,272.50	6.94
49	300316	晶盛机电	11,407,362.68	6.72
50	600588	用友网络	10,820,995.27	6.38
51	603983	丸美股份	10,811,987.00	6.37
52	300463	迈克生物	10,724,696.49	6.32
53	002100	天康生物	10,711,362.49	6.31
54	002372	伟星新材	10,678,931.86	6.29
55	002916	深南电路	10,567,847.00	6.23
56	002230	科大讯飞	10,482,807.56	6.18
57	603317	天味食品	10,423,960.40	6.14
58	002216	三全食品	10,308,820.00	6.08
59	603659	璞泰来	10,242,169.00	6.04
60	300496	中科创达	10,194,500.00	6.01
61	002815	崇达技术	10,159,369.33	5.99
62	300207	欣旺达	9,951,688.60	5.87
63	002582	好想你	9,773,792.80	5.76
64	002185	华天科技	9,445,362.68	5.57
65	600584	长电科技	9,211,403.23	5.43
66	002271	东方雨虹	9,095,151.00	5.36
67	600570	恒生电子	8,893,004.00	5.24
68	000002	万科A	8,755,560.00	5.16
69	002008	大族激光	8,748,413.22	5.16
70	603186	华正新材	8,665,479.00	5.11
71	603799	华友钴业	8,569,618.64	5.05
72	600600	青岛啤酒	8,263,881.40	4.87
73	300760	迈瑞医疗	7,887,679.00	4.65
74	600073	上海梅林	7,830,045.75	4.61
75	300446	乐凯新材	7,684,878.80	4.53
76	600585	海螺水泥	7,594,461.84	4.48
77	002746	仙坛股份	7,311,234.25	4.31

78	601678	滨化股份	7,295,284.01	4.30
79	603960	克来机电	7,079,210.14	4.17
80	002920	德赛西威	7,047,858.54	4.15
81	603658	安图生物	6,928,852.95	4.08
82	600132	重庆啤酒	6,850,853.30	4.04
83	300575	中旗股份	6,807,392.00	4.01
84	603345	安井食品	6,798,196.36	4.01
85	002812	恩捷股份	6,794,592.00	4.00
86	002912	中新赛克	6,688,722.38	3.94
87	300134	大富科技	6,687,027.00	3.94
88	002027	分众传媒	6,677,671.20	3.94
89	603517	绝味食品	6,625,545.00	3.90
90	002384	东山精密	6,601,829.00	3.89
91	002396	星网锐捷	6,594,333.01	3.89
92	603118	共进股份	6,523,067.20	3.84
93	000100	TCL 集团	6,472,999.00	3.81
94	002405	四维图新	6,362,457.50	3.75
95	002821	凯莱英	6,349,588.00	3.74
96	002385	大北农	6,269,560.00	3.70
97	300747	锐科激光	6,243,574.30	3.68
98	300595	欧普康视	6,214,687.00	3.66
99	300482	万孚生物	6,144,552.90	3.62
100	300618	寒锐钴业	6,090,046.00	3.59
101	688012	中微公司	6,059,706.07	3.57
102	002273	水晶光电	6,056,147.00	3.57
103	002241	歌尔股份	5,973,752.00	3.52
104	002466	天齐锂业	5,929,213.00	3.49
105	603127	昭衍新药	5,878,542.00	3.46
106	000671	阳光城	5,765,790.42	3.40
107	002049	紫光国微	5,676,764.00	3.35
108	603583	捷昌驱动	5,595,335.86	3.30
109	300251	光线传媒	5,560,118.00	3.28
110	600201	生物股份	5,549,323.70	3.27
111	300253	卫宁健康	5,535,775.85	3.26
112	300628	亿联网络	5,522,823.00	3.25
113	300474	景嘉微	5,496,615.00	3.24
114	300639	凯普生物	5,496,051.00	3.24
115	002099	海翔药业	5,482,907.00	3.23
116	601222	林洋能源	5,440,484.00	3.21
117	300613	富瀚微	5,435,317.00	3.20
118	002233	塔牌集团	5,433,793.00	3.20
119	300558	贝达药业	5,295,832.00	3.12

120	300529	健帆生物	5,287,575.00	3.12
121	603515	欧普照明	5,260,668.20	3.10
122	300357	我武生物	5,230,870.07	3.08
123	000895	双汇发展	5,227,672.00	3.08
124	603708	家家悦	5,206,726.05	3.07
125	300024	机器人	5,186,766.00	3.06
126	002174	游族网络	5,163,364.00	3.04
127	603806	福斯特	5,092,529.60	3.00
128	600703	三安光电	5,081,657.00	2.99
129	601066	中信建投	5,028,298.33	2.96
130	300679	电连技术	4,976,188.35	2.93
131	300188	美亚柏科	4,925,206.41	2.90
132	300166	东方国信	4,873,123.00	2.87
133	002156	通富微电	4,851,758.40	2.86
134	688008	澜起科技	4,820,700.30	2.84
135	600563	法拉电子	4,792,614.00	2.82
136	002675	东诚药业	4,684,042.94	2.76
137	300124	汇川技术	4,675,463.00	2.76
138	002129	中环股份	4,666,374.20	2.75
139	000425	徐工机械	4,608,582.00	2.72
140	600195	中牧股份	4,556,021.00	2.69
141	002409	雅克科技	4,423,909.00	2.61
142	603678	火炬电子	4,335,909.00	2.56
143	002555	三七互娱	4,298,610.00	2.53
144	300315	掌趣科技	4,285,093.00	2.53
145	603959	百利科技	4,215,821.00	2.48
146	600176	中国巨石	4,144,800.66	2.44
147	002511	中顺洁柔	4,128,539.50	2.43
148	600298	安琪酵母	4,111,863.04	2.42
149	603039	泛微网络	3,986,167.00	2.35
150	300396	迪瑞医疗	3,932,643.68	2.32
151	601689	拓普集团	3,880,974.00	2.29
152	300662	科锐国际	3,875,368.00	2.28
153	000860	顺鑫农业	3,773,544.52	2.22
154	603711	香飘飘	3,771,252.60	2.22
155	300438	鹏辉能源	3,767,865.00	2.22
156	603005	晶方科技	3,726,800.00	2.20
157	002568	百润股份	3,710,008.00	2.19
158	300577	开润股份	3,613,335.25	2.13
159	300685	艾德生物	3,573,849.40	2.11
160	300088	长信科技	3,552,621.00	2.09
161	600048	保利地产	3,523,731.00	2.08

162	002683	宏大爆破	3,473,629.00	2.05
163	603609	禾丰牧业	3,449,492.45	2.03
164	300363	博腾股份	3,442,344.50	2.03
165	300502	新易盛	3,433,621.00	2.02

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,030,143,412.75
卖出股票收入(成交)总额	2,017,650,597.87

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 报告期末按公允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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

1、芒果超媒

本报告期，本基金持有芒果超媒，其发行主体因未按照规定设立专门账簿、保险销售过程中存在误导性陈述，被中国银保监会湖南监管局公开处罚。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	230,785.89
2	应收证券清算款	6,928,645.33
3	应收股利	—
4	应收利息	5,288.92
5	应收申购款	1,302,619.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	8,467,339.58

8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
11,459	16,926.31	1,141,250.21	0.59	192,817,329.53	99.41

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年2月10日） 基金份额总额	2,317,605,629.49
本报告期期初基金份额总额	176,899,509.05
本报告期基金总申购份额	297,998,521.49
减：本报告期基金总赎回份额	280,939,450.80
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	193,958,579.74

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 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，基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
光大证券	2	1,365,000,172.65	33.76%	970,925.10	35.95%	-
国信证券	1	879,987,487.94	21.76%	537,936.90	19.92%	-
国泰君安	1	574,055,995.96	14.20%	350,924.32	12.99%	-

兴业证券	2	446,357,922.55	11.04%	317,495.57	11.76%	-
华创证券	1	303,363,758.92	7.50%	185,446.74	6.87%	-
广发证券	3	241,375,816.61	5.97%	171,694.96	6.36%	-
安信证券	2	101,952,527.72	2.52%	72,518.75	2.69%	-
中金公司	2	76,146,403.01	1.88%	54,162.90	2.01%	-
中泰证券	1	55,404,303.75	1.37%	39,406.67	1.46%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注:1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，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) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

- a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证

券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

在本报告期内本基金新增中信证券的 395288 深圳交易单元，新增国盛证券的 008480 深圳交易单元，44698 上海交易单元，新增申万宏源的 43217 上海交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	69,400,000.00	57.31%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	51,700,000.00	42.69%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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旗下基金参加云南红塔银行网上银行、手机银行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 4 月 4 日
7	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
8	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
9	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资科创板股票的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 6 月 22 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加云南红塔银行网上银行、手机银行基金申购及定期定额投资手续	中国证监会指定的媒介	2019 年 7 月 5 日

	费率优惠活动的公告		
11	工银瑞信基金管理有限公司关于基金直销电子自助交易系统开通平安银行支付渠道并进行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 8 月 1 日
12	关于工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 8 月 16 日
13	工银瑞信基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 10 月 23 日
14	工银瑞信基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 134 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 11 月 9 日
15	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 12 月 31 日
16	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 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、自 2019 年 8 月 14 日起，农冰立不再担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理，详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报监管机构备案，基金管理人对本基金的基金合同、托管协议信息披露有关条款进行了修改，详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、《工银瑞信中小盘成长混合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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 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

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 4 月 8 日