工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金

2014 第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银金融地产股票
交易代码	000251
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月26日
报告期末基金份额总额	238,117,358.92份
投资目标	通过分析金融地产行业的商业模式与利润区,深入挖掘金融地产行业内治理结构与成长潜力良好、具有行业领先优势的上市公司进行投资,在控制投资风险的同时,力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。
业绩比较基准	80%×沪深300金融地产行业指数收益率+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、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于金融地产行业股票,其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。根据《工银瑞信基金管理公司基金风险等级评价体系》,本基金的风险评级为中高风险。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	35,758,425.81
2.本期利润	46,579,821.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.2081
4.期末基金资产净值	332,505,625.68
5.期末基金份额净值	1.396

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3)所列数据截止到2014年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.92%	0.98%	7.18%	0.88%	9.74%	0.10%

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

注:1、本基金基金合同于2013年8月26日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例不低于60%,债券等固定收益类资产占基金资产的比例为5%-40%。其中,本基金投资于金融地产行业内的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
鄢耀	本基金的基金经理	2013年8月26日	-	7	先后在德勤华永会计师事务所有限公司担任高级审计员,中国国际金融有限公司担任分析员;2010年加入工银瑞信,曾任研究部研究员。2013年8月26日至今,担任工银瑞信金融地产行业股票型基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银添福债券基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银月月薪定期支付债券基金基金经理;2014年9月19日起至今,担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理。
王君正	本基金的基金经理	2013年8月26日	-	6	曾任泰达宏利基金管理有限公司研究员;2011年加入工银瑞信,曾任研究部研究员。2013年8月26日至今,担任工银瑞信金融地产行业股票型基金基金经理。

4.2 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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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。

4.3.2 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所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度货币政策继续放松,宏观经济在政策支持下出现了企稳的迹象,金融地产股在7月份取得较好表现,但是随后市场再度转向转型和改革,金融地产股表现一般。工银瑞信金融地产基金通过灵活的在地产、银行、保险、券商进行切换,同时深度挖掘行业内优质个股,取得了较好的绝对涨幅和相对涨幅。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为16.92%,业绩比较基准收益率为7.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央要求完成全年的经济任务,稳增长的动力越来越强,货币政策和房地产政策持续放松,我们有望看到房地产销量逐步探底回升,经济下行风险可控,金融地产有望随着利率下行、基本面企稳迎来较好的表现。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	302,694,838.22	89.97
	其中:股票	302,694,838.22	89.97
2	固定收益投资	16,531,505.70	4.91
	其中:债券	16,531,505.70	4.91
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	200,000.00	0.06
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,447,750.67	3.40
7	其他资产	5,564,128.63	1.65
8	合计	336,438,223.22	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	337,928.00	0.10
C	制造业	32,159,497.97	9.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,961,462.26	4.20
E	建筑业	29,258.28	0.01
F	批发和零售业	2,919,600.00	0.88
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	17,929,462.82	5.39
J	金融业	189,477,154.34	56.98
K	房地产业	45,880,474.55	13.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	302,694,838.22	91.03

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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600000	浦发银行	3,183,000	31,034,250.00	9.33
2	000712	锦龙股份	1,000,000	17,690,000.00	5.32
3	601601	中国太保	909,518	17,653,744.38	5.31
4	601318	中国平安	384,288	15,886,465.92	4.78
5	600705	中航资本	800,000	15,064,000.00	4.53
6	601818	光大银行	5,000,000	13,850,000.00	4.17
7	601628	中国人寿	798,037	12,409,475.35	3.73
8	601555	东吴证券	1,199,820	12,358,146.00	3.72
9	000671	阳光城	978,599	12,330,347.40	3.71
10	601328	交通银行	2,500,000	10,725,000.00	3.23

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,023,000.00	3.01
	其中:政策性金融债	10,023,000.00	3.01
4	企业债券	2,344,650.00	0.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,163,855.70	1.25
8	其他	-	-
9	合计	16,531,505.70	4.97

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。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国开07	100,000	10,023,000.00	3.01
2	110015	石化转债	38,190	4,163,855.70	1.25
3	112190	11亚迪02	23,100	2,344,650.00	0.71

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	589,077.81
2	应收证券清算款	3,986,299.25
3	应收股利	-
4	应收利息	262,420.26
5	应收申购款	726,331.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,564,128.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	4,163,855.70	1.25

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600705	中航资本	15,064,000.00	4.53	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	181,323,757.83
报告期期间基金总申购份额	218,192,205.47
减:报告期期间基金总赎回份额	161,398,604.38
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	238,117,358.92

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。

工银瑞信主题策略股票型证券投资基金

2014 第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银主题策略股票
交易代码	481015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月24日
报告期末基金份额总额	93,921,942.60份
投资目标	结合宏观经济转型方向,通过分析社会经济热点动向,把握相关主题投资机会,追求基金资产长期稳定的增值和收益,在控制投资风险的同时,力争持续实现超越业绩基准的收益。
投资策略	类别资产配置上,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;在股票投资方面,本基金主要采取主题投资策略,在宏观经济发展的不同阶段,关注经济发展热点,深入挖掘潜在的主题投资机会,寻找实质受益的上市公司,并综合考虑其基本面情况,选择具备投资价值的股票,构建投资组合,并不断优化组合,争取获得超越业绩基准的收益水平。本基金还将在法规允许的范围内,基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理,为基金收益提供增加价值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率 + 20%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币市场基金,属于风险水平较高的基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	6,817,484.17
2.本期利润	23,581,363.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.2948
4.期末基金资产净值	153,908,432.12
5.期末基金份额净值	1.639

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)"本期已实现收益"指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;"本期利润"为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3)所列数据截止到2014年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.32%	1.15%	10.84%	0.72%	10.48%	0.43%

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

注:1、本基金基金合同于2011年10月24日生效。

2、按基金合同规定,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的相关规定:本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具及其他资产占基金资产的比例为5%-40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄安乐	权益投资部副总监,本基金的基金经理	2011年11月23日	-	11	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,现任权益投资部副总监,2011年11月23日至今担任工银主题策略股票基金基金经理,2013年9月23日至今担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。

4.2 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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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。

4.3.2 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所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年3季度,市场大幅度上涨,各类指数普遍涨幅较大,尤其是中证500和中证700名列前茅,表明在3季度,中小市值的股票领涨。本基金在3季度,坚持了一贯的主题投资的运作思路,即在节能环保、国防军工、医疗服务及新一代信息技术等几个方向进行了精选个股的集中投资,从运行的结果看,这些领域的投资均获得了较好的绝对回报和较高的相对收益,贡献较为突出的是医疗服务里的重合个股,以及超配比例较大的国防军工板块。此外,在3季度,我们参与了电力改革主题的投资,总体回报较好。对组合贡献较小的板块是我们之前买入的畜禽养殖板块,但考虑到我们的投资逻辑没有发生改变,因此对这部分的仓位没有作调整。而2季度中考虑参与的基础化工、大宗商品等领域的投资,我们少量参与,但仍以精选个股为主,投资期限也较短,总体效果一般。

3季度总体投资回报较好,但由于宏观经济和企业盈利本身并未有趋势性的好转,股票的上涨更多体现了改革和转型的预期,因此我们也时刻警惕回调的风险,尤其是对我们持仓较重的个股和板块,密切地跟踪和进一步深入的分析是十分必要的。4季度,我们仍坚持在前述几个大的主题方向的投资,同时对主题里的个股进行甄别,进行优质个股的集中投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为21.32%,业绩比较基准收益率为10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济本身依旧乏善可陈,传统行业仍有降低杠杆、产能出清的要求,而同时,新兴产业时刻在寻求突破;短期来看,我们难以期望看到亮丽的经济数据,也看不到企业盈利能力的显著上升;这也意味着,如果股市能够上行,盈利的增长短期而言并不可靠;而估值的提升反而是一个途径,这可能更多的依赖于改革和转型的预期,以及行业内部以及跨界的并购整合行为。

总体来看,这是一个推陈出新的时期,各种转型和改变使得经济和企业面临巨大挑战,与之对应,也意味着机会纷呈;我们认为,不论是传统产业的升级、新兴产业的突围、商业模式的创新,技术研发的进步,都会隐藏着了大量的投资机会。所以,中短期内,市场未必有整体的牛市行情,但应该会存在局部的市场行情。

基于这一认识,我们致力于发掘结构性的主题投资机会,并且坚持挖掘最受益主题驱动、下行风险小而上升空间大的优秀的股票,进行集中的中长线投资;目前,我们看好节能环保、医疗服务、国防军工、高端装备、电力改革、周期拐点(主要是畜禽养殖)等几个大主题。我们相信,坚持主题投资的正确方法和灵活策略,淡化短期波动,将会给投资者带来中长期的丰厚回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	141,603,566.60	86.94
	其中:股票	141,603,566.60	86.94
2	固定收益投资	4,993,000.00	3.07
	其中:债券	4,993,000.00	3.07
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	12,655,196.33	7.77
7	其他资产	3,629,538.24	2.23
8	合计	162,881,301.17	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,936,740.16	5.81
B	采矿业	4,728,400.00	3.07
C	制造业	81,797,175.87	53.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,554,760.57	12.71
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	21,790,590.00	14.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,795,900.00	3.12
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	141,603,566.60	92.01

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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300016	北陆药业	650,000	11,121,500.00	7.23
2	300086	康芝药业	479,950	7,736,794.00	5.03
3	300281	金明精机	300,000	7,650,000.00	4.97
4	002421	达实智能	240,000	7,608,000.00	4.94
5	300213	佳讯飞鸿	330,000	7,520,700.00	4.89
6	000883	湖北能源	1,561,638	7,199,151.18	4.68
7	002458	益生股份	440,000	5,852,000.00	3.80
8	600979	广安爱众	500,020	3,580,143.20	2.33
9	600995	文山电力	418,089	3,223,466.19	2.09
10	600765	中航重机	120,000	3,132,000.00	2.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,993,000.00	3.24
	其中:政策性金融债	4,993,000.00	3.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,993,000.00	3.24

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。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	50,000	4,993,000.00	3.24

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

根据康芝药业2013年11月7日公告,公司2013年3月19日披露的《关于公司2011年半年度及2011年第三季度财务信息更正的公告》显示,公司2011年半年报告及2011年第三季度报告存在重大会计差错。更正后,2011年半年度报告归属于母公司股东的净利润减少了953.85万元,与更正前相比下降了43.10%;2011年第三季度报告归属于母公司股东的净利润减少530.51万元,与更正前相比下降了36.99%。

上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则(2012年修订)》第2.1条的相关规定。康芝药业董事长兼总裁洪江游、董事兼副总裁洪江涛、时任董事会秘书李幽泉、财务总监刘会良未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,给与公开批评处分。

根据康芝药业2014年7月2日公告,公司存在以下违法事实:提前确认销售收入,虚增2011年利润1,568,139.83元;应计未计期间费用,虚增2011年和2012年利润分别为2,384,964.00元和2,307,903.00元。公司的上述行为,违反了《证券法》第六十三条、第六十八条规定,构成了《证券法》第一百九十三条所述违法行为。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券法》第一百九十三条规定,中国证券监督管理委员会对康芝药业给予警告,并处35万元罚款。

根据康芝药业2014年8月18日公告,公司2014年4月11日披露的《关于前期会计差错更正的公告》显示,公司2011年年度报告的财务信息存在重大会计差错。更正前,2011年度归属于母公司股东的净利润为盈利281.60万元;更正后,2011年度归属于母公司股东的净利润为亏损113.71万元。该更正事项导致2011年度归属于母公司股东的净利润下降了395.31万元,且盈亏性质发生变化。康芝药业的上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则(2012年修订)》第2.1条、第11.3.1条以及第11.3.4条的相关规定。

鉴于康芝药业及相关当事人的上述违规事实和情节,深圳证券交易所根据《创业板股票上市规则(2012年修订)》第16.2条、第16.3条的相关规定,经深圳证券交易所纪律处分委员会审议通过,对康芝药业给予通报批评的处分。

上述所列事项对公司的生产经营活动基本无影响。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	73,440.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,457.03
5	应收申购款	3,490,640.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,629,538.24

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002458	益生股份	5,852,000.00	3.80	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	77,134,960.75
报告期期间基金总申购份额	35,636,349.53
减:报告期期间基金总赎回份额	18,849,367.68
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	93,921,942.60

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信主题策略股票型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信主题策略股票型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信主题策略股票型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。

工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金

2014 第三季度报告

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
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信中小盘股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	521,128,247.03份
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	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于中小盘股票,在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	14,483,263.18
2.本期利润	84,001,146.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.1525
4.期末基金资产净值	536,309,647.61
5.期末基金份额净值	1.029

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、"本期已实现收益"指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;"本期利润"为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

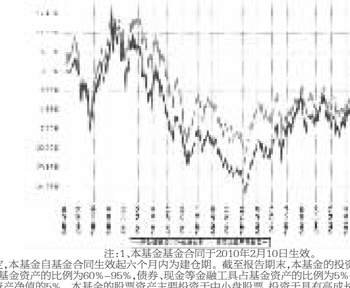
3、所列数据截止到2014年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.60%	0.94%	17.45%	0.73%	0.15%	0.21%

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



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。截至报告期末,本基金的投资范围及各项比例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%,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%。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%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王筱苓	本基金的基金经理	2011年10月11日	-	17	曾任中国银行全球金融市场部首席交易员。2005年加入工银瑞信,曾任工银核心价值基金、工银精选平衡混合型基金、工银稳健成长股票型基金基金经理、专户投资部专户投资经理,2011年10月11日至今,担任工银中小盘基金基金经理;2012年12月5日至今,担任工银大盘蓝筹基金基金经理;2014年6月26日至今,担任工银绝对收益策略混合型发起式基金基金经理。
胡文彪	本基金的基金经理	2012年11月20日	-	13	先后在国泰君安证券股份有限公司担任研究员,华林证券有限公司担任研究员;2006年加入工银瑞信基金管理有限公司,历任产品开发部高级经理和权益投资部高级经理;2009年3月5日至2011年2月10日,担任工银沪深300基金基金经理;2009年8月26日至2011年2月10日,担任工银上证央企ETF基金基金经理;2010年2月10日至2011年3月16日,担任工银中小盘基金基金经理;2011年2月10日至2013年1月18日,担任工银双利债券基金基金经理;2011年3月16日至今,担任工银大盘蓝筹基金基金经理;2012年11月20日至今担任工银中小盘基金基金经理;2013年11月12日至今,担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。

4.2 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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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。

4.3.2 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所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度是年内股票指数涨幅最大的季度,上证指数上涨15.40%,沪深300指数上涨13.20%,创业板指数上涨9.69%,风格上延续了中小盘股票表现较好的趋势。本季度,股票市场出现明显上涨,交易也比较活跃,7月份大盘股反弹,8-9月中小盘股上涨。期间所有中信一级行业均有上涨,涨幅较大的行业有国防军工、农林牧渔、纺织服装、交通运输、机械、商贸零售、钢铁等,涨幅较小的行业有银行、保险、家电、传媒、食品饮料、石油石化等。

本基金在上半年取得正超额收益基础上,本季度继续取得正超额收益。本基金坚持持有优质成长性、中小盘股票,在周期性行业反弹过程中适度参与了房地产、有色、煤炭、券商等行业。虽然上市公司盈利增长预期一般,但是主题投资、并购重组、政策红利预期等因素主导市场持续上涨。在市场出现普涨局面下,适当减持了部分涨幅较大的个股,继续持有涨幅较小、近几年大幅下跌的个股,等待估值消化、估值修复或上市公司经营改善。期末,本基金主要超配的行业有通信、国防军工、医疗服务、非银行金融、农林牧渔、传媒等,配置较低的有电力设备、房地产、交通运输、汽车、有色金属等。当前组合的风格主要在中小盘成长股票方面,周期性行业、大市值股票整体呈现低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为17.60%,业绩比较基准收益率为17.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济方面,政府稳增长措施是经济企稳的主要原因,但是总体上仍然处于新常态,难有超预期的经济增长和下滑。预计年内经济增长呈现弱势,通胀趋势上处于高位,流动性中性偏紧。国际经济温和复苏,其中美国经济复苏带动美元走强可能导致全球资本市场、商品市场动荡加剧。

虽然股票指数有所上涨、交投明显活跃,但我们对股票市场整体表现仍然偏谨慎。A股市场的总体环境没有改变,国内经济仍然处于转型期,估值修复、并购重组、产业转型、政策红利等投资机会并存并不断轮换。改革红利降低股市风险溢价,正如中国宏观经济转型前景不明,但充满期望一样,股票市场的上涨主要来自估值提升而非业绩增长,但对经营改善及新业务开拓充满预期。本基金投资组合的行业配置,风格上仍偏向成长性行业,并适度均衡配置周期性行业,重点配置通信、国防军工、医药、券商、农林牧渔、高速铁路设备、环保等稳健成长和快速成长性行业,以及数字城市、移动互联网(互联网教育、移动医疗、移动娱乐等)、北斗信息、低空开放等子行业。个股选择方面,部分并购整合、产业转型的公司也可以继续参与。本基金以中长期公司成长空间及行业发展视角选择优质个股,继续坚持发掘A股市场中成长性股票的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	495,587,648.97	91.77
	其中:股票	495,587,648.97	91.77
2	固定收益投资	30,075,000.00	5.57
	其中:债券	30,075,000.00	5.57
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	13,266,804.35	2.46
7	其他资产	1,095,013.92	0.20
8	合计	540,024,467.24	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,904,022.52	1.66
B	采矿业	11,903,900.00	2.22
C	制造业	255,342,068.12	47.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,430.00	0.00
E	建筑业	4,564,000.00	0.85
F	批发和零售业	23,652,313.58	4.41
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	102,009,964.31	19.02
J	金融业	32,660,914.04	6.09
K	房地产业	6,009,500.00	1.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,812,503.90	2.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,681,732.50	2.92
R	文化、体育和娱乐业	22,043,300.00	4.11
S	综合	-	-
	合计	495,587,648.97	92.41

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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300288	朗玛信息	190,000	21,006,400.00	3.92
2	000783	长江证券	2,620,000	17,894,600.00	3.34
3	600763	通策医疗	325,010	15,681,732.50	2.92
4	300113	顺网科技	480,000	14,256,000.00	2.66
5	002311	海大集团	1,200,000	13,452,000.00	2.51
6	600118	中国卫星	550,000	13,194,500.00	2.46
7	600038	哈飞股份	359,941	12,669,923.20	2.36
8	300020	银江股份	400,000	12,260,000.00	2.29
9	300075	数字政通	315,000	10,908,450.00	2.03
10	300133	华策影视	310,000	10,636,100.00	1.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,075,000.00	5.61
	其中:政策性金融债	30,075,000.00	5.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	30,075,000.00	5.61

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。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140404	14农发04	300,000	30,075,000.00	5.61

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,110.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	977,775.47
5	应收申购款	97,127.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,095,013.92

5.11.4 报告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债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300075	数字政通	10,908,450.00	2.03	重大事项
2	300133	华策影视	10,636,100.00	1.98	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	578,513,803.50
报告期期间基金总申购份额	19,965,039.89
减:报告期期间基金总赎回份额	77,350,596.36
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	521,128,247.03

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金募集的文件;
2、《工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。