工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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：二〇一四年三月三十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月17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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银瑞信中小盘股票
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	634,062,374.07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。

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	李芳菲
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-63201816

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	52,301,338.07	-144,254,528.81	-146,360,469.95
本期利润	100,412,796.77	-28,166,692.47	-264,490,860.28
加权平均基金份额本期利润	0.1463	-0.0365	-0.3135
本期基金份额净值增长率	19.69%	-5.26%	-29.67%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1536	-0.2789	-0.2388
期末基金资产净值	547,266,069.25	531,412,124.61	639,944,609.92
期末基金份额净值	0.863	0.721	0.761

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

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

3.本基金基金合同生效日为2010年2月10日。

3.2 基金净值表现

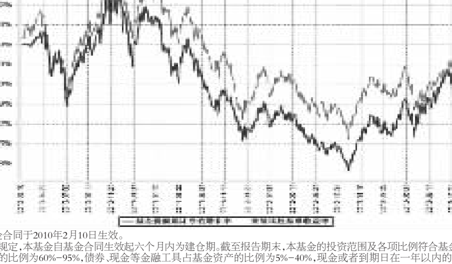
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.06%	1.33%	-1.09%	1.06%	-3.97%	0.27%
过去六个月	14.76%	1.35%	11.89%	1.09%	2.87%	0.26%
过去一年	19.69%	1.34%	9.00%	1.13%	10.69%	0.21%
过去三年	-20.24%	1.25%	-18.46%	1.17%	-1.78%	0.08%
自基金合同生效起至今	-13.70%	1.32%	-9.14%	1.23%	-4.56%	0.09%

注：1、本基金的业绩比较基准为：80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为2010年2月10日。

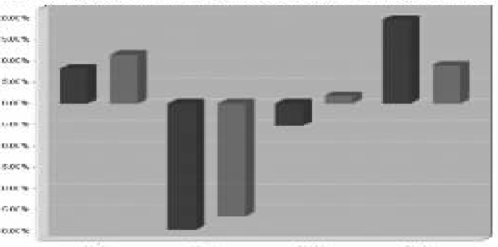
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于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%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本基金基金合同生效日为2010年2月10日；

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金成立以来未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于2005年6月21日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至2013年12月31日，公司旗下管理42只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利ETF联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信7天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信60天理财债券型证券投资基金、工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信安心增利场内实时申赎货币市场基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾1100亿元人民币。

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		
王筱苓	本基金的基金经理	2011年10月11日	-	16	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。
胡文彪	本基金的基金经理	2012年11月20日	-	12	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。
郝联峰	曾任本基金的基金经理	2012年7月4日	2013年7月16日	13	先后在海通证券历任高级研究员、投资经理，国都证券担任证券投资总部副总经理，中国再保险资产管理股份有限公司历任权益投资部助理总经理、研究发展部助理总经理，招商基金管理有限公司担任首席经济学家兼研究总监兼基金经理； 2010年加入工银瑞信，曾任专户投资总监，2012年4月26日至2013年6月7日担任工银基本面量化策略股票基金基金经理，2012年7月4日至2013年7月16日担任工银中小盘股票基金基金经理。

注：1、任职日期说明：

1）王筱苓的任职日期为公司执委会决议日期
2）郝联峰的任职日期为公司执委会决议日期
3）胡文彪的任职日期为公司执委会决议日期

2、离任日期说明：郝联峰的离任日期为公司执委会决议日期

3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4、本基金无基金经理助理

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

1、公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2、适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、开放式基金。投资经理，指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

3、公平交易的具体措施

3.1 在研究和投资决策环节：

3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部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，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

3.1.2各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行，在授权的范围内，独立、自主、审慎决策。

3.1.3 基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

3.1.4对于涉及到关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。

3.2在交易执行环节：

3.2.1交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。

3.2.2公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施，保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

3.2.3公平交易执行方法：

3.2.3.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确地执行。

3.2.3.2在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于涉及到同一证券品种的交易执行，系统自动通过公平交易模块完成。

公平交易模块执行原理如下：

1）同向交易指令：

a）限价指令：交易员采用投资交易系统中的公平委托系统，按照各组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行；b）市价指令：对于市价同向交易指令，交易员首先应该按照“时间优先”的原则执行交易指令，并在接到后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，交易员应采用投资交易系统中的公平委托模块，按照各基金委托数量设置委托比例，按比例具体执行；c）部分限价指令与部分市价指令：对于不同基金经理下达的不同类型的同向交易指令，交易员应该按照“价格优先”的原则执行交易指令，在市场价格未达到限价时，先执行市价指令、后执行限价指令；

2）反向交易指令

a）交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b）根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关条款，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令；c）同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d）确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易，按要求投资组合经理要填写反向交易申请表，并要求相关投资经理提供决策依据，并保留记录备查。e）以上反向交易要求完全按照指数的构成进行投资的组合等除外。

3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况，各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》，银行间市场债券买卖和回购交易，由交易员填写《银行间市场交易审批单》，经相关基金经理/投资经理、交易主管审批，并由交易员双人复核后方可执行。公司对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易，填写《大宗交易申请表》，经公司主管领导、法律合规部审批后执行。债券一级市场交易，填写《债券投标审批表》及《债券分销审批表》，经公司主管领导、法律合规部审批后执行。其他非集中竞价交易，参考上述审批流程执行。

3.2.5 对于非公开发行股票申购，各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》，独立确定申购价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司主管领导、法律合规部及其公司主管领导审核批准后执行。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，有关申购方案和分配方案应报公司主管领导、法律合规部，以保证分配结果符合公平交易的原则。

3.2.7公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议，或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况，交易主管将具体情况报告公司主管领导，公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争议内容进行协调处理。

3.3公平交易的检查和价格监控

3.3.1 法律合规部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核，并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况，就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问，由基金/投资经理作出合理解释。

3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息，对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，如发现异常情况的，基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理性解释。

3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。风险管理部和法律合规部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。

3.4 评估和分析

3.4.1风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，进行专项说明，提交法律合规部，法律合规部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

3.4.2中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。法律合规部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内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%，应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。其中，中央交易室负责公平交易制度的披露，法律合规部负责公平交易控制方法的披露，风险管理部负责按本制度3.4.1条的规定对公平交易制度执行情况中当年度同向交易价差的专项分析。

4.报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 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。

公司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，本报告期未出现公司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5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

2013年上证指数下跌6.75%，沪深300指数下跌7.65%，创业板指数上涨82.73%。指数分化非常严重，中小盘成长股票的表现十分亮丽，传统大盘股票持续下跌。全年涨幅靠前的行业有传媒、计算机、通信、电子，跌幅较大的行业有白酒、煤炭、有色、房地产、保险等。

基金本年度取得了一定的超额收益，主要收益来自一些成长性较好的行业和个股，包括传媒、计算机、环保、通信、医药等行业。虽然由于配置的原因，在房地产等部分传统行业出现一些损失，但投资组合总体偏中小盘成长，因此总体上抓住了投资机会并控制了损失风险。年末，为降低2014年成长股调整风险的可能性，年末对成长股进行了适当减持，期末主要配置的行业有医药、传媒、非银行金融、国防军工、计算机、农林牧渔、食品饮料等，配置较低的有电力设备、家电、建材、建筑、汽车、银行等。年初风格趋于防御，行业以均衡配置为主线，偏离比例不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年，本基金份额净值增长率为 19.69%，比较基准收益率为 9.00% 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年，我们认为当前中国的宏观经济增长趋弱，通货膨胀趋于稳定但处于高位，资金利率水平难以明显上行。预计2014年宏观经济及通货膨胀水平总体上温和、平稳。2013年四季度资金价格的反弹可能已经对产业经济产生影响，包括房地产贷款销售受到资金成本影响等方面。新的一年里，经济仍然偏弱，预计资金价格小幅度回落，但仍会保持相对高位；输入型通胀压力短期较低，但国内高企的价格因素仍然存在。国际经济方面，美国经济复苏势头最强，日本、欧洲随其后；国际经济回升部分由其再工业化推动，对中国经济的拉动弹性有限。

新的一年里，我们对股票市场整体上偏谨慎。预计2014年股票市场负收益的可能性不大，估值不会进一步下降，但收益率不会很大，主要赚取业绩增长的收益。国内经济仍然处于转型期，传统行业平稳，估值难有大幅提升；增长较快的行业主要集中在成长性行业，仍然是取得较高投资的主要来源。延续过去一年的投资经验，自下而上的个股选择仍然是投资的主要方法，在股市波动不剧烈的情况下，资产配置不会进行大幅变动。行业选择方面，规避周期股和小股票，偏向消费类行业，重点配置石油化工、电力、家电、纺织服装、食品饮料、农林牧渔、铁路设备、光伏、LED、种子、化肥等稳健成长和快速成长性子行业，以及受益于技术进步及政府投资的数字城市、4G及移动互联网、新兴消费电子、汽车电子、北斗信息、国防军工等子行业。本基金将继续坚持通过深入研究，发掘具有持续成长性股票的投资机会，力争继续取得超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1参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

4.6.1.1职责分工

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、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

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。

4.6.1.2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。

4.6.2 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。

4.6.3 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。

4.6.4 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。

4.7 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。

§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

在托管工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金的过程中，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《工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》的约定，对工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司2013年1月1日至2013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工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金的投资运作、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《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工银瑞信中小盘成长股票型证券投资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

本年度报告被出具了无保留意见的审计报告，且在审计报告中无强调事项，投资者欲了解详细内容，可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§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股票型证券投资基金
报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款		561,216.47	263,650.33
结算备付金		611,583.65	4,711,228.51
存出保证金		52,173.10	1,082,743.11
交易性金融资产		520,206,805.22	484,250,512.24
其中：股票投资		480,422,805.22	439,771,512.24
基金投资		-	-
债券投资		39,784,000.00	44,479,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资			
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	41,000,000.00
应收证券清算款		26,534,672.08	10,815,429.51
应收利息		1,032,812.16	771,781.16
应收股利		-	-
应收申购款		65,444.62	5,924.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		549,064,707.30	542,901,269.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
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		-	7,630,781.17
应付赎回款		515,504.42	1,031,054.27
应付管理人报酬		696,327.15	632,744.82
应付托管费		116,054.53	105,457.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		161,829.43	685,680.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		308,922.52	1,403,426.35
负债合计		1,798,638.05	11,489,144.69
所有者权益：			
实收基金		634,062,374.07	736,933,129.05
未分配利润		-86,796,304.82	-205,521,004.44
所有者权益合计		547,266,069.25	531,412,124.61
负债和所有者权益总计		549,064,707.30	542,901,269.30

注：1.报告截止日2013年12月31日，基金份额净值为人民币0.863元，基金份额总额为634,062,374.07份。

2.本基金基金合同生效日为2010年2月10日。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		111,565,438.78	-13,281,744.86
1.利息收入		1,527,605.48	2,362,080.42
其中：存款利息收入		72,289.99	245,537.50
债券利息收入		1,113,219.18	1,358,402.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		342,096.31	758,140.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		61,853,081.67	-131,816,637.25
其中：股票投资收益		56,287,083.68	-137,685,016.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益		192,978.08	492,345.35
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,373,019.91	5,376,033.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		48,111,458.70	116,087,836.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		73,292.93	84,975.63
减：二、费用		11,152,642.01	14,884,947.61
1.管理人报酬		8,338,992.75	8,601,264.27
2.托管费		1,389,832.08	1,433,544.06
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,020,804.86	4,446,034.09
5.利息支出		591.21	1,655.16
其中：卖出回购金融资产支出		591.21	1,655.16
6.其他费用		402,421.11	402,450.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,412,796.77	-28,166,692.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,412,796.77	-28,166,692.47

注：本基金基金合同生效日为2010年2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股票型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	736,933,129.05	-205,521,004.44	531,412,124.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	100,412,796.77	100,412,796.77
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）	-102,870,754.98	18,311,902.85	-84,558,852.13
其中：1.基金申购款	47,949,597.22	-8,445,204.19	39,504,393.03
2.基金赎回款	-150,820,352.20	26,757,107.04	-124,063,245.16
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）	634,062,374.07	-86,796,304.82	547,266,069.25
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	840,707,494.03	-200,762,884.11	639,944,609.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-28,166,692.47	-28,166,692.47
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）	-103,774,364.98	23,408,572.14	-80,365,792.84
其中：1.基金申购款	29,041,216.64	-7,478,851.18	21,562,365.46
2.基金赎回款	-132,815,581.62	30,887,423.32	-101,928,158.30
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）	736,933,129.05	-205,521,004.44	531,412,124.61

注：本基金基金合同生效日为2010年2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：

郭特华	毕万英	朱辉毅
基金管理公司负责人	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股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），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他金融工具。本基金投资组合资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中具有高成长性、基本面良好的中小盘股票占股票投资资产的比例不低于80%。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%。本基金的业绩比较基准为：80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4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。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

7.4.6 税项

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

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、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《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。

7.4.7 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：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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,338,992.75	8,601,264.27
其中：支付销售机构的客户维护费	2,297,672.18	2,387,595.49

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,389,832.08	1,433,544.06

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易.

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	561,216.47	47,354.76	263,650.33	196,988.09

注：1、本年度期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

2、上年度期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与上述各关联方及托管人股东承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（ 2013年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 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
300190	维尔利	2013年12月23日	重大事项	22.06	2014年3月10日	24.27	119,915	2,138,502.96	2,645,324.90	-
300010	立思辰	2013年12月5日	重大事项	11.88	2014年3月5日	13.07	185,809	2,196,725.39	2,207,410.92	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末在银行间市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末在交易所市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	480,422,805.22	87.50
	其中：股票	480,422,805.22	87.50
2	固定收益投资	39,784,000.00	7.25
	其中：债券	39,784,000.00	7.25
	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	1,172,800.12	0.21
7	其他各项资产	27,685,101.96	5.04
8	合计	549,064,707.30	100.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,183,200.00	0.95
B	采矿业	15,228,482.96	2.78
C	制造业	251,380,702.36	45.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,640,400.00	1.21
F	批发和零售业	22,238,215.57	4.06
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	70,236,255.26	12.83
J	金融业	37,226,644.22	6.80
K	房地产业	19,946,509.75	3.64
L	租赁和商务服务业	6,282,000.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,545,824.90	2.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,406,820.20	1.90
R	文化、体育和娱乐业	22,107,750.00	4.04
S	综合	-	-
	合计	480,422,805.22	87.79

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。

8.3 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	002311	海大集团	1,300,000	15,262,000.00	2.79
2	000783	长江证券	1,310,000	13,624,000.00	2.49
3	300113	顺网科技	219,936	11,276,118.72	2.06
4	600118	中国卫星	598,000	11,080,940.00	2.02
5	600763	通策医疗	325,010	10,406,820.20	1.90
6	002038	双鹭药业	200,000	10,110,000.00	1.85
7	300288	朗玛信息	204,000	10,077,600.00	1.84
8	300020	银江股份	400,000	10,000,000.00	1.83
9	600038	哈飞股份	359,941	9,894,778.09	1.81
10	300133	华策影视	310,000	9,889,000.00	1.81

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

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	600809	山西汾酒	8,542,076.18	1.61
2	300027	华谊兄弟	7,589,846.58	1.43
3	600109	国金证券	7,580,550.09	1.43
4	600038	哈飞股份	7,025,970.33	1.32
5	300113	顺网科技	6,996,424.14	1.32
6	600030	中信证券	6,828,277.05	1.28
7	300090	盛运股份	6,312,467.29	1.19
8	000063	中兴通讯	6,252,455.84	1.18
9	300020	银江股份	5,788,641.50	1.09
10	601117	中国化学	5,534,503.26	1.04
11	000917	电广传媒	5,377,045.55	1.01
12	600859	王府井	4,820,352.85	0.91
13	601299	中国北车	4,761,574.20	0.90
14	601699	潞安环能	4,756,399.14	0.90
15	000888	峨眉山A	4,610,984.79	0.87
16	002501	利源精制	4,511,491.00	0.85
17	000553	沙隆达A	4,201,552.81	0.79
18	002467	二六三	4,067,748.00	0.77
19	300101	国腾电子	3,859,584.60	0.73
20	000728	国元证券	3,741,990.05	0.70

注：1、买入包括基金申购新股、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	300027	华谊兄弟	22,384,961.18	4.21
2	300315	掌趣科技	16,343,982.24	3.08
3	600887	伊利股份	12,042,496.05	2.27
4	600066	宇通客车	11,470,335.39	2.16
5	601318	中国平安	9,137,223.85	1.72
6	000728	国元证券	8,314,257.82	1.56
7	300212	易华录	7,985,135.20	1.50
8	002419	天虹商场	7,855,687.13	1.48
9	002221	东华能源	7,597,353.98	1.43
10	000157	中联重科	6,916,400.00	1.30
11	601009	南京银行	6,644,902.64	1.25
12	000417	合肥百货	6,311,406.45	1.19
13	002501	利源精制	5,977,509.87	1.12
14	002140	东华科技	5,896,073.44	1.11
15	600030	中信证券	5,795,036.20	1.09
16	000002	万 科A	5,728,248.14	1.08
17	000063	中兴通讯	5,699,881.31	1.07
18	002142	宁波银行	5,559,108.51	1.05
19	000543	皖能电力	5,557,548.45	1.05
20	601117	中国化学	5,550,098.86	1.04

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	296,307,723.89
卖出股票收入（成交）总额	359,936,381.37

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,997,000.00	5.48
	其中：政策性金融债	29,997,000.00	5.48
4	企业债券	4,970,500.00	0.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,816,500.00	0.88
8	其他	-	-
9	合计	39,784,000.00	7.27

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。

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130201	13国开01	300,000	29,997,000.00	5.48
2	126011	08石化债	50,000	4,970,500.00	0.91
3	113001	中行转债	50,000	4,816,500.00	0.88

8.7 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。

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没有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。

8.12.2 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	52,173.10
2	应收证券清算款	26,534,672.08
3	应收股利	-
4	应收利息	1,032,812.16
5	应收申购款	65,444.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,685,101.96

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	4,816,500.00	0.88

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

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
18,386	34,486.15	24,484,666.27	3.86%	609,577,707.80	96.14%

9.3 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	-	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为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	736,933,129.05
本报告期基金总申购份额	47,949,597.22
减：本报告期基金总赎回份额	150,820,352.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	634,062,374.07

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，本基金未召开持有人大会。

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：

2013年2月2日，基金管理人发布了《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第三届董事会十五次会议审议并通过，夏洪彬先生不再担任副总经理职务，副总经理职务由毕万英先生担任；

基金管理人于2013年10月30日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第四十八次股东会和第三届董事会第二十二次会议审议通过，李晓鹏先生辞去公司董事长职务，董事长变更为陈焕祥先生；

基金管理人于2013年12月28日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告》，经基金管理人第四十八次股东会审议并通过，法定代表人变更为郭特华女士。

2、基金托管人：

无。

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人、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

无。

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）审计费用捌万元整，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

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
华创证券	1	316,557,701.97	48.31%	280,121.77	47.78%	-
瑞银证券	1	252,696,532.38	38.57%	230,053.36	39.24%	-
红塔证券	1	85,968,320.21	13.12%	76,073.57	12.98%	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

注：1.券商的选择标准和程序

（1）选择标准：注重综合服务能力

a)券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b)券商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、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c)与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

（2）选择程序

a)确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b)签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2.券商的评估、保留和更换程序

（1）席位的租用期限暂定为一年，合同到期15天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

（2）对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

（3）若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

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
华创证券	-	-	5,000,000.00	0.29%	-	-
瑞银证券	-	-	1,712,500,000.00	99.71%	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。