（上接B87版）

联系人:沈晨
电话：010-59336544
传真：010-59336586
客户服务电话:4008-909-998
网址：www.jnlc.com
（91）和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座
法定代表人:李淑慧
联系人:胡静华
电话:0371-85518396
传真:0371-85518397
客户服务电话:4000-555-671
网址：www.hgccpb.com
（92）奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人：叶健
电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客户服务电话:400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（93）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
（94）北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:曲哲伦
电话:010-58170911
传真:010-58170800
客户服务电话:400 818 8866
网址:http://fund.shengshiview.com/
（95）上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:吴鸿飞
电话:021-65370077-268
传真:021-55085991
客户服务电话:400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
（96）深圳安见基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区海德一道中州控股中心B座32K
法定代表人:吴永宏
联系人:陈鹏
电话:0755-86382002
客户服务电话:400-800-8668
网址:www.ph6.com
（97）南京途牛基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人:宋时琳
联系人:张士帅
电话:025-86853969
传真:025-86853960
客户服务电话:4007-999-999转3
网址:http://jr.tuniu.com/
（98）北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址:北京市西城区西直门外大街1号院2号楼
法定代表人:王伟刚
联系人:王骁骁
电话:010-56251471
传真:010-62680827
客户服务电话:400-619-9059
网址:www.hcjijin.com
（99）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:张林
电话:010-85594745
传真:010-85932427
客户服务电话:400-066-8586
网址：www.igesafe.com
（100）北京广源达信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区宏泰东街浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
联系人:姜英华
电话:010-52798634
传真:010-82055860
客户服务电话:400-623-6060
网址：www.niuniufund.com
（101）上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
电话:021-50712782
传真：021-5071 0161
客户服务电话:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn
（102）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
联系人：陈霞
电话:010-59313555
传真:010-53509643
客户服务电话:4008-980-618
网址：www.chtwm.com
（103）天津国美基金销售有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层
法定代表人:丁东华
联系人:郭宝亮
电话:010-59287061
传真:010-59287825
客户服务电话:400-111-0889
网址:www.gomefund.com
（104）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:李春光
联系人:徐江
电话:0411-88891212
传真:0411-84396536
客户服务电话:400-0411-001
网址:www.taichengcaifu.com
（105）方德保险代理有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号19层A2017
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号19层A2017
法定代表人:夏予柱
联系人:胡明哲
电话:010-64068617
传真:010-68091380
客户服务电话:400-106-0101
网址:www.fundsure.com
（106）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座
法定代表人:赵芯蕊
联系人:李唯
电话:010-62675768
传真：8610-62676582
客户服务电话：010-62675369
网址：www.xincai.com
（107）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区显龙山路19号1幢4层1座401
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部A座
法定代表人:江卉
联系人:黄立影
电话:010-89188345
传真:89189566
客户服务电话：个人业务:95118 企业业务:400 088 8816
网址:http://fund.jd.com
（108）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋玥
电话：010-88066632
传真:010-63136184
客户服务电话：400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
（109）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层
法定代表人:钟斐斐
联系人：侯芳芳
电话:010-61840688
传真:010-84997571
客户服务电话:400-159-9288
网址:https://danjuanapp.com
（110）济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
电话：010-65309516
传真:010-65330699
客户服务电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
（111）上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
联系人:孙琦
电话:021-50810683
传真:021-50810687
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
（112）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
联系人:张慧
电话:025-66996699-882796
传真:无
客户服务电话:95177
网址:www.snjijin.com
（113）大连网金基金销售有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法定代表人:樊怀东
联系人:贾伟刚
电话:0411-39027808
传真:0411-39027835
客户服务电话:4000-899-100
网址:www.yibaijin.com
（114）北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址:北京市海淀区信息路甲9号奎科大厦
法定代表人:张旭阳
联系人:霍博华
电话:010-61952703
传真:010-61951007
客户服务电话:95055-4
网址:www.baiyingfund.com
（115）玄元保险代理有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永谙
联系人:卢亚博
电话:021-50701053
传真:021-50701053
客户服务电话:021-50701053
网址:http://www.xyinsure.com/kfit_xybx
（116）中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区光华路16号中期大厦A座9层
法定代表人:王兵
联系人:赵森
联系电话:010-65807399
客服电话:95162
网址:www.cifco.net
基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时履行公告义务。
（二）基金登记机构
名 称:工银瑞信基金管理有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
注册登记业务办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层
法定代表人:王海璐
全国统一客户服务电话:400-811-9999
传 真:010-66583100
联系人:朱辉毅
（三）律师事务所及经办律师
名 称:北京市天元律师事务所
住 所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人:朱小辉
电 话:010-57763888
传 真:010-57763777
经办律师:吴冠雄、李晗
（四）会计师事务所及经办注册会计师
名 称:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住 所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:李慧明,王珊珊
联系电话:（010）58152145
传真:（010）58114645
联系人:王珊珊

四、基金的名称

工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,积极选择深度受益的新兴蓝筹股票,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,力争获取超越业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%－95%,其中,投资于本基金界定的新蓝筹主题股票占非现金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上,采用动态调整策略,在市场上涨阶段中,适当增加权益类资产配置比例,在市场下行周期中,适当降低权益类资产配置比例,力求实现基金财产的长期稳定增值,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。

2、股票选择策略

（1）新蓝筹主题的界定

本基金“新蓝筹”主题的界定为:以下四类上市公司的股票。

A .行业发展状况良好,企业处于成长阶段或成熟阶段的早期,市场竞争能力强,企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力;过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于GDP 增长率的新兴蓝筹上市公司;B.企业盈利能力较强,主营业务盈利水平较高;财务管理能力较强,现金收支安排有序,资产盈利水平较高;主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性的蓝筹上市公司;C.企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应的行业龙头上市公司;D .已实施改革方案,或具有改革预期的传统蓝筹公司。

未来随着企业转型,新蓝筹主题股票的识别及认定也会随之调整。如因基金管理人界定新蓝筹主题的方法调整或者上市公司经营发生变化不再属于本基金管理人所界定的新蓝筹主题的,本基金持有的新蓝筹主题股票的比例低于非现金基金资产的80%,本基金将在三十个工作日之内进行调整。

（2）股票选择

本基金投资从经济增长的长期规律出发,结合我国最新的经济发展战略和经济结构调整方向,采取自下而上的价值型投资策略,通过定性分析与定量分析相结合的办法,以“新蓝筹”资本增值型投资为主导,非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景。本基金对市场运行特征进行跟踪,选取在行业中已处于龙头地位且具备长期核心竞争优势、持续稳定成长性、估值相对合理和价值稳定成长的新蓝筹主题优质上市公司的股票进行重点投资。

1）定性分析

本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据,主要包括以下几个方面:

A、公司的竞争优势:重点考察公司的市场优势,在细分市场是否占据领先位置,是否具有品牌号召力或较高的行业知名度等;资源优势,包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源,比如市场资源、专利技术等;产品优势,包括是否拥有对产品的定价能力等以及其他优势;

B、公司治理评估:本基金认为具有良好公司治理机制的公司具有以下几个方面的特征:①公司治理框架保护并便于行使股东权利,公平对待所有股东;②尊重公司相关利益者的权利;③公司信息披露及时、准确、完整;④公司董事会勤勉、尽责,运作透明;⑤公司股东能够对董事会成员施加有效的监督,公司能够保证外部审计机构独立、客观地履行审计职责。不符合上述治理准则的公司,本基金将给予其较低的评级。

C、公司的盈利模式:对企业盈利模式的考察重点关注企业盈利模式的属性以及成熟程度,考察核心竞争力的不可复制性、可持续性、稳定性;

2）定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析,以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。包括:成长性指标（收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等）、财务指标（毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等）、估值指标（PE、PEG、PS等）。

3、股指期货投资策略

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点,采用股指期货在短期内取代部分现货,获取市场敞口,投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时,为避免市场冲击,提前建立股指期货多头头寸,然后逐步买入现货并解除股指期货多头,当完成现货建仓后将股指期货平仓;空头套期保值指当基金需要卖出现货时,先建立股指期货空头头寸,然后逐步卖出现货并解除股指期货空头,当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中,将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合beta的稳定性,精细化确定投资方案比例。

4、债券投资策略

本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

(1)利率策略

研究GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期,以规避债券价格下降的风险和资本损失,获得较高的再投资收益;预期市场利率将下降时,提高组合的久期,在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益,并获得较高利息收入。

(2)信用策略

根据国民经济运行周期阶段,分析债券发行人所处行业发展前景,发行人业务发展状况,企业市场地位,财务状况,管理水平,债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定债券的信用风险利差与投资价值。

(3)债券选择与组合优化

本基金将根据债券市场情况,基于利率期限结构及债券的信用级别,在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上,评估债券投资价值,选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合,并根据市场变化情况对组合进行优化。

(4)可转换债券投资

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点,是本基金的重要投资对象之一。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,以合理价格买入并持有。

5、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证,或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合,力求取得最优的风险调整收益。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

九、基金的业绩比较基准

1、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

80%×沪深300指数收益率＋20%×中债综合财富指数收益率。

2、选择理由

沪深300指数是由中证指数有限公司编制,由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成,综合反映了沪深A股市场整体表现。中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场,成份券种包括除资产支持债和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

本基金是股票型证券投资基金,股票投资比例为80-95%,本基金对沪深300指数和中债综合财富指数分别赋予80%和20%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合的报告期为2019年4月1日起至6月30日止（财务数据未经审计）。

1.1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	222,180,602.39	84.00
	其中:股票	222,180,602.39	84.00
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	30,086,000.00	11.37
	其中:债券	30,086,000.00	11.37
	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	11,305,958.42	4.27
8	其他资产	921,880.55	0.35
9	合计	264,494,441.36	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。

1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,916,237.60	1.87
B	采矿业	162,565.15	0.06
C	制造业	116,328,490.86	44.17
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	5,659,049.28	2.15
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,733,494.56	5.59
J	金融业	62,723,511.79	23.81
K	房地产业	11,103,230.55	4.22
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	6,554,022.60	2.49
S	综合	–	–
	合计	222,180,602.39	84.35

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。

1.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

1.3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	600036	招商银行	507,481	18,259,166.38	6.93
2	000895	双汇发展	706,445	17,583,416.05	6.68
3	002142	宁波银行	552,189	13,385,061.36	5.08
4	600519	贵州茅台	13,490	13,274,160.00	5.04
5	601318	中国平安	141,891	12,572,961.51	4.77
6	600132	重庆啤酒	253,014	11,932,140.24	4.53
7	600600	青岛啤酒	233,777	11,672,485.61	4.43
8	000333	美的集团	202,700	10,512,022.00	3.99
9	000651	格力电器	177,689	9,772,895.00	3.71
10	000858	五粮液	77,124	9,096,775.80	3.45

1.4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	30,086,000.00	11.42
	其中:政策性金融债	30,086,000.00	11.42
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	30,086,000.00	11.42

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。

1.5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	190304	19进出04	200,000	19,994,000.00	7.59
2	170407	17农发07	100,000	10,092,000.00	3.83

1.6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。

1.7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。

1.8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。

1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1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。

1.9.2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。

1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1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。

1.10.2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。

1.10.3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。

1.11投资组合报告附注

1.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

1、招商银行

本报告期,本基金持有招商银行,其发行主体因授信调查不全面,未能有效识别、反映客户授信集中风险等问题,被中国银保监会广西监管局处以罚款。

2、宁波银行

本报告期,本基金持有宁波银行,其发行主体因将同业存款变为一般性存款,被银保监会宁波监管局处以罚款。

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。

1.11.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	127,779.66
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	154,626.91
5	应收申购款	639,473.98
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	921,880.55

1.11.4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。

1.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

1.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。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。

1、本基金合同生效日为2015年8月6日,基金合同生效以来（截至2019年6月30日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示:

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
2015.8.6-2015.12.31	1.70%	0.27%	-1.65%	1.89%	3.35%	-1.62%
2016年	4.62%	1.26%	-8.44%	1.12%	13.06%	0.14%
2017年	30.17%	0.62%	17.22%	0.51%	12.95%	0.11%
2018年	-16.75%	1.20%	-19.26%	1.07%	2.51%	0.13%
2019.1.1-2019.6.30	22.38%	1.35%	21.85%	1.24%	0.53%	0.11%
自基金合同生效日起至今	41.10%	1.06%	3.84%	1.11%	37.26%	-0.05%

2、本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较:

（2015年8月6日至2019年6月30日）

注:1、本基金基金合同于2015年8月6日生效。

2、根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例为80%－95%,其中,投资于本基金界定的新蓝筹主题股票占非现金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费;

（2）基金托管人的托管费;

（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;

（5）基金份额持有人大会费用;

（6）基金的证券、期货交易费用;

（7）基金的银行汇划费用;

（8）基金的相关账户的开户及维护费用;

（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5 %年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.5 %÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,,基金托管人于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,,基金托管人于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第（3）－（9）项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

（3）《基金合同》生效前的相关费用;

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金管理费和基金托管费的调整

在法律法规允许的条件下,基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率和基金托管费率,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金对申购设置级差费率,投资者在一天之内如有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费率如下表所示:

基金的申购费率结构

费用种类	申购金额（M）	费率
申购费	M＜100万	1.5%
	100万≤M＜300万	1.0%
	300万≤M＜500万	0.8%
	500万≤M	按笔收取,1,000元/笔

注:M为申购金额

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费将全额计入基金财产;对持续持有期不少于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期不少于6个月的投资人收取的赎回费总额的25%计入基金财产。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减,具体费率如下:

基金的赎回费率结构

	持有期限	赎回费率
赎回费率	Y＜7天	1.5%
	7天≤Y＜30天	0.75%
	30天≤Y＜1年	0.50%
	1年≤Y＜2年	0.30%
	Y≥2年	0%

注:Y为持有期限,1年指365天。

3、赎回费用未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人主要人员情况等相关内容。

2、在“四、基金托管人”部分,根据基金托管人提供内容对本基金托管人的情况进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”部分,更新了基金销售机构信息。

4、在“九、基金的投资”部分,更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

5、在“十、基金的业绩”部分,更新了本基金截至2019年6月30日的基金业绩的内容。

6、在“十七、基金的风险揭示”部分,更新了“本基金的特有风险”相关的内容。

7、在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分,修改了“关于联络方式”相关的内容。

8、在“二十二、其他应披露事项”部分,更新了本次更新内容期间的有关本基金的所有公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,投资人欲查询本更新招募说明书正文,可登陆工银瑞信基金管理有限公司网站www.icbccs.com.cn。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一九年九月十九日

证券代码:002426 证券简称:胜利精密 公告编号:2019-091

苏州胜利精密制造科技股份有限公司
关于发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金限售股份上市流通提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:

1、本次解除限售的股份为公司2015年发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金中发行的股份,涉及股东人数为4名。本次解除限售股份数量为29,238,449股,占公司总股本的0.8496%。

2、本次限售股份可上市流通日:2019年9月20日。

一、公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金

1、发行股份情况

公司于2015年1月15日召开的第三届董事会第七次会议和2015年2月2日召开的2015年第一次临时股东大会审议通过了重大资产重组的相关议案,公司通过发行股份及支付现金方式购买陈铸等5名股东所持有的南京德乐科技股份有限公司100%股份,王汉仓等7名股东所持有的苏州市智诚光学科技有限公司73.31%股权,以及王书庆、吴加富、缪磊等3名股东所持有的苏州富强科技有限公司100%股权,同时向不超过10名其他特定投资者发行股份募集配套资金用于本次交易现金对价的支付,上述事项已经中国证券监督管理委员会于2015年7月30日下发的“证监许可[2015]1848号”《关于核准苏州胜利精密制造科技股份有限公司向王汉仓等发行股份购买资产并募集配套资金的批复》核准。

2015年8月,公司向王汉仓等15名交易对方发行152,919,467股股份用于购买标的资产,该部分新增股份已在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完成股份登记手续,并于2015年9月10日在深圳证券交易所上市。

2015年8月,公司向3名特定对象非公开发行28,179,262股股份募集重大资产重组配套资金约4.59亿元,该部分新增股份已在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完成登记手续,并于2015年9月10日在深圳证券交易所上市。

本次非公开发行数量合计181,098,729股,其中发行股份购买资产的发行数量为152,919,467股,募集配套资金的发行数量为28,179,262股。发行股份购买资产的发行价格为9.00元/股,募集配套资金的发行价格为16.28元/股。发行后公司总股本1,166,647,793股。

2、发行对象认购的数量

（1）发行股份购买资产的发行对象认购数量

序号	发行对象	发行数量(股)
1	王汉仓	10,941,089
2	沈益平	4,689,033
3	桑海玲	3,907,533
4	桑海燕	1,674,656
5	苏州日亚吴中国发创业投资企业（有限合伙）	1,672,533
6	陆祥元	1,116,434
7	苏州工业园区镛博投资中心（有限合伙）	796,466
8	王书庆	40,296,355
9	吴加富	15,498,589
10	缪磊	6,199,445
11	陈铸	54,959,412
12	南京德聚投资管理有限公司	3,315,111
13	苏州高达汇丰创业投资有限公司（注1）	3,559,367
14	南京高达梧桐创业投资基金(有限合伙)	1,483,033
15	浙江中科东海创业投资合伙企业(有限合伙)	2,810,411
	合计	152,919,467

注1:苏州高达汇丰创业投资有限公司已于2016年2月4日更名为南京高达汇丰创业投资有限公司。

（2）募集配套资金的发行对象认购数量

序号	获配对象名称	获配股数（股）
1	中欧盛世资产管理（上海）有限公司	2,825,552
2	财通基金管理有限公司	21,498,771
3	博时资本管理有限公司	3,854,939
	合计	28,179,262

2016年9月,以上发行对象中除陆祥元以外的17位股东,已将所持有期满12个月的公司股份解除限售,解除限售股份的数量为197,669,108股,占公司总股本的6.8%（总股本2,906,123,555股）,解除限售股份的上市流通日分别为2016年9月12日、2016年9月26日,详细内容见2016 年9月9日、2016年9月27日公司信息披露媒体《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）刊登的《关于发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金限售股份上市流通提示性公告》（公告编号:2016-074）、《关于发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金之交易对方陈铸所持限售股份上市流通提示性公告》（公告编号:2016-075）。

2017年9月,王汉仓等8名自然人股东已将所持有期满24个月的公司股份解除限售,解除限售股份的数量为103,624,580股,占公司总股本的3.0288%（总股本3,421,275,069股）,解除限售股份的上市流通日为2017年9月11日,详细内容见 2017 年9月7日公司信息披露媒体《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）刊登的《关于发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金限售股份上市流通提示性公告》（公告编号:2017-107）。

2018年9月,王汉仓等9名自然人股东已将所持有期满36个月的公司股份解除限售,解除限售股份的数量为71,315,921股,占公司总股本的2.0722%（总股本3,441,517,719股）,解除限售股份的上市流通日为2018年9月10日,详细内容见 2018 年9月6日公司信息披露媒体《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）刊登的《关于发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金限售股份上市流通提示性公告》（公告编号:2018-100）。

二、本次限售股形成后至今公司股本变动情况

1、2016年4月20日召开的2015年度股东大会,审议通过了《关于回购公司重大资产重组标的资产未完成业绩承诺对应股份的议案》。根据补偿协议约定,公司将以1元总价回购注销王书庆、吴加富和缪磊2015年度应补偿股份4,198,371股,占公司回购前总股本1,166,647,793股的0.3599%。公司于2016年5月31日完成了上述股份回购注销业务,公司总股本由原1,166,647,793股变更为1,162,449,422股。

本次注销股份前,发行对象限售股持股总数为181,098,729股;本次注销股份后,发行对象限售股持股总数为176,900,358股。

2、2016年4月20日召开2015年度股东大会,审议通过了《2015年年度利润分配预案》,公司2015年年度权益分派方案为:以公司现有总股本1,162,449,422股为基数,向全体股东每10股派0.5元人民币现金;同时,以资本公积金向全体股东每10股转增15股。分红前本公司总股本为1,162,449,422股,分红后总股本增至2,906,123,555股。本次权益分派股权登记日为:2016年6月20日,除权除息日为:2016年6月21日。

本次利润分配前,发行对象限售股持股总数为176,900,358股;本次利润分配后,发行对象限售股持股总数为442,250,895股。

2016年9月,发行对象所持有期满12个月的公司股份已解除限售,本次解除限售后,发行对象限售股持股总数为244,581,787股。

2017年9月,发行对象所持有期满24个月的公司股份已解除限售,本次解除限售后,发行对象限售股持股总数为140,957,207股。

2018年9月,发行对象所持有期满36个月的公司股份已解除限售,本次解除限售后,发行对象限售股持股总数为69,641,286股。

3、2015年11月17日,公司召开2015年第四次临时股东大会,审议通过了《关于公司非公开发行股票方案的议案》等相关议案;2016年11月8日,公司召开2016年第四次临时股东大会,审议通过了《关于延长公司2015年度非公开发行股票股东大会决议有效期的议案》等相关议案。2016年11月28日,非公开发行股票工作已完成,发行股票数量为515,151,514股,公司股本由2,906,123,555股变更为3,421,275,069股。本次股本变动对2015年发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金对象限售股持股数量无影响。

4、2018年1月25日,公司召开2018年第一次临时股东大会,审议通过了《关于公司〈2018年股票期权与限制性股票激励计划（草案）〉及其摘要的议案》。2018年1月25日,公司分别召开了第四届董事会第七次会议和第四届监事会第七次会议,审议通过了《关于调整公司2018年股票期权与限制性股票激励计划相关事项的议案》等相关议案。2018年3月20日,向45名激励对象授予的20,242,650股限制性股票完成登记上市。公司股本由3,421,275,069股变更为3,441,517,719股。本次股本变动对2015年发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金对象限售股持股数量无影响。

截至本公告日,公司总股本为3,441,517,719股,限售股股数为1,155,557,559股。

三、申请解除股份限售的股东履行承诺情况

1、本次申请解除股份限售的股东做出的承诺

本次胜利精密发行股份购买资产的交易对方陈铸等4名自然人以资产认购而取得的胜利精密股份自股份上市之日起12个月内不转让（如因本次发行获得胜利精密股份时,交易对方对用于认购股份的资产持续拥有权益的时间不足12个月的,则取得的对应股份自股份上市之日起36个月内不转让）。12个月之后,在盈利承诺期内若实现盈利承诺,或者虽未实现盈利承诺但履行完毕盈利补偿,则按照下表所示比例分五期解禁可转让股份。相应股份解禁后按照中国证监会及深交所的有关规定执行。

序号	名称	第一期	第二期	第三期	第四期	第五期	2015年度发行股份合计数（股）
1	陈铸	30%	30%	20%	10%	10%	54,959,412
2	王书庆	30%	30%	20%	10%	10%	40,296,355
3	吴加富	30%	30%	20%	10%	10%	15,498,589
4	缪磊	30%	30%	20%	10%	10%	6,199,445
	合计	–	–	–	–	–	116,953,801

第一期应在股份上市之日满12个月且实现盈利承诺或充分履行补偿义务后方可解除限售;

第二期应在股份上市之日满24个月且实现盈利承诺或充分履行补偿义务后方可解除限售;

第三期应在股份上市之日满36个月且实现盈利承诺或充分履行补偿义务后方可解除限售;

第四期应在股份上市之日满48个月方可解除限售;

第五期应在股份上市之日满60个月方可解除限售。

2、根据天衡会计师事务所（特殊普通合伙）出具的2015-2017年度子公司盈利预测实现情况的专项审核报告,南京德乐科技股份有限公司已实现2015-2017年度的盈利预测,苏州富强科技有限公司已实现2016、2017年度的盈利预测。公司已于2016年5月31日完成对苏州富强科技有限公司股东王书庆、吴加富和缪磊未实现2015年度业绩承诺对应股份的回购注销。具体内容详见公司在指定媒体《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《关于子公司2015年度盈利预测实现情况的说明》（2016-034）、《关于子公司2016年度盈利预测实现情况的说明》（2017-046）、《关于子公司2017年度盈利预测实现情况的说明》（2018-038）。

综上所述,本期为第四期限售股解禁,申请解除股份限售的陈铸等4名自然人股东已严格履行了上述承诺,符合本期解除限售的条件。

本期解除限售股份计算公式为股东2015年度发行股份总数*2015年度权益分派（以资本公积金向全体股东每10股转增15股,即2.5）*第四期解禁比例10%。

陈铸先生本期解禁股数=54,959,412*2.5*10%=13,739,853股

王书庆先生本期解禁股数=40,296,355*2.5*10%=10,074,088股

吴加富先生本期解禁股数=15,498,589*2.5*10%=3,874,647股

缪磊先生本期解禁股数=6,199,445*2.5*10%=1,549,861股

本期解除限售股份总数为29,238,449股,2020年度应解除限售股份数为29,238,458股。

3、本次申请解除限售股份的股东不存在非经营性占用上市公司资金的情形,上市公司也不存在对其违规担保的情形。

四、本次解除限售股份的上市流通安排

1、本次解除限售股份的上市流通日为2019年9月20日。

2、本次解除限售股份的数量为29,238,449股,占公司总股本的0.8496%。

3、本次申请解除股份限售的股东人数为4名。

4、股份解除限售及上市流通具体情况:

单位:股

序号	股东全称	所持限售条件股份总数	本次发行股份所持限售条件股份总数（2018年解除限售后）	本次申请解除限售数量	备注
1	王书庆	22,372,867	20,148,179	10,074,088	本次申请解除限售的股份中处于质押冻结的股份数量为10,074,088股
2	吴加富	27,831,867	7,749,297	3,874,647	1、现任董事注1; 2、本次申请解除限售的股份中处于质押冻结的股份数量为3,874,647股
3	缪磊	4,235,216	3,099,725	1,549,861	本次申请解除限售的股份中处于质押冻结的股份数量为1,549,861股
4	陈铸	80,510,009	27,479,706	13,739,853	本次申请解除限售的股份中处于质押冻结的股份数量为13,739,853股
	合计	134,949,959	58,476,907	29,238,449	——

注1:吴加富先生为公司现任董事,在任职期间每年转让股份不得超过其所持有的公司股份总数的25%。

五、解除限售前后股本结构变化情况表

本次限售股份上市流通后,胜利精密股本结构的变动情况如下:

单位:股

股本结构	本次解除限售前	本次变动股份数	本次解除限售后
一、限售流通股（或非流通股）	1,155,557,559	-29,238,449	1,126,319,110
二、无限售流通股	2,285,960,160	29,238,449	2,315,198,609
三、总股本	3,441,517,719	–	3,441,517,719

六、备查文件

1、限售股份上市流通申请表;

2、限售股份上市流通申请书;

3、股本结构表和限售股份明细表;

4、天衡会计师事务所（特殊普通合伙）出具的2015-2017年度子公司盈利预测实现情况的专项审核报告。

苏州胜利精密制造科技股份有限公司

董事会

2019年9月18日