

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	44

7.3 期末按行业分类的权益投资组合	44
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	45
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	55
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	57
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	58
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	58
7.11 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息	73
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金
基金简称	工银全球股票（QDII）
基金主代码	486001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 2 月 14 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	680,716,737.96 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	为中国国内投资者提供投资全球范围内受益于中国经济持续增长的公司的机会，通过在全球范围内分散投资，控制投资组合风险，追求基金长期资产增值，并争取实现超越业绩比较基准的业绩表现。
投资策略	本基金主要投资于在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，以及全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，为中国国内投资者提供全球范围内分散投资路径。本基金在选择股票时，重点从中国国内消费、中国进口需求、中国出口优势三个主题识别直接受益于中国经济增长的公司。
业绩比较基准	40%×MSCI 中国指数收益率+60%×MSCI 全球股票指数收益率。
风险收益特征	本基金属于全球股票型基金，在一般情况下，其风险与预期收益高于债券型基金，亦高于混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	许俊
	联系电话	400-811-9999	010-66594319
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	王海璐	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Wellington Management Company, LLP	Citibank N.A.
	中文	威灵顿管理有限责任公司	美国花旗银行有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	701 East 60th Street North, Sioux Falls, South Dakota 57104, County of Minnehaha, USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	399 Park Avenue, New York, NY10022, USA
邮政编码		2210	10022

注：威灵顿管理有限责任公司自 2012 年 7 月 10 日起，担任本基金的境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人或基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,627,000.77
本期利润	89,727,518.81
加权平均基金份额本期利润	0.1334
本期加权平均净值利润率	9.51%

本期基金份额净值增长率	10.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	137,306,315.12
期末可供分配基金份额利润	0.2017
期末基金资产净值	1,053,044,879.49
期末基金份额净值	1.547
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	156.55%

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 2008 年 2 月 14 日。

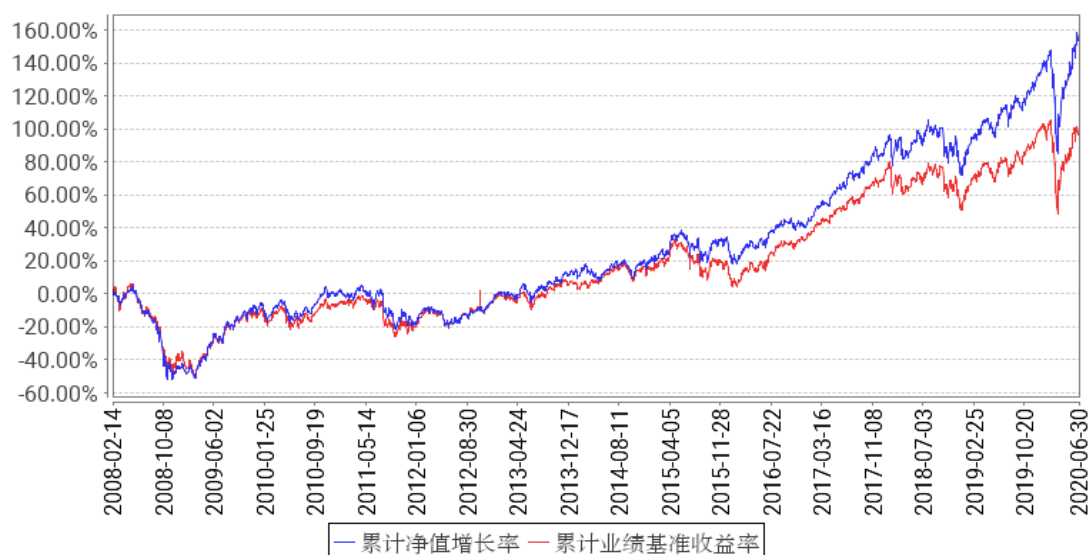
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.62%	1.20%	4.41%	1.31%	2.21%	-0.11%
过去三个月	23.76%	1.33%	17.78%	1.54%	5.98%	-0.21%
过去六个月	10.37%	2.07%	-0.25%	2.14%	10.62%	-0.07%
过去一年	22.92%	1.52%	10.64%	1.55%	12.28%	-0.03%
过去三年	55.89%	1.13%	31.18%	1.13%	24.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	156.55%	1.13%	98.28%	1.20%	58.27%	-0.07%

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

工银全球股票（QDII）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、本基金合同于 2008 年 2 月 14 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制中的规定：本基金投资中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%；本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 60%，政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具占基金资产的比例不高于 40%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

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 2020 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信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 150 只公募基金。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游 凇 峰	本基金的基金经理	2009 年 12 月 25 日	-	24 年	斯坦福大学统计学专业博士；先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金基金经理，Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理，Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金基金经理；2009 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资部权益投资能力六中心负责人；2009 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银全球精选股票基金的基金经理；2012 年 4 月 26 日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理；2014 年

					6 月 26 日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理；2015 年 12 月 15 日至 2017 年 12 月 22 日，担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理；2016 年 3 月 9 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理；2016 年 10 月 10 日至 2018 年 2 月 23 日，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 27 日至今，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 10 月 24 日至 2019 年 12 月 23 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金(QDII)基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
John A. Boselli, CFA	投资组合经理	35	威灵顿管理有限责任合伙制公司合伙人，工商管理硕士，在管理美国、国际和全球股票投资组合方面均有丰富的投资经验。曾在《路透》评选的“企业二十佳基金经理人”中排名第十一。此外，在《巴伦周刊》2011 年的“超级人才”报道中，John A. Boselli 先生亦被评为全球顶尖的股票分析师之一。
Bo Z.	投资组合经理	25	威灵顿管理有限责任合

Meunier (张博女士), CFA			伙制公司合伙人, 工商管理硕士, 她同时也是一名股票研究分析师, 专门研究新兴市场, 并主要负责中国。她对其负责行业内的企业进行基本面分析并根据分析结果和市场条件做出买入/卖出建议。张博女士于 1998 年获得巴布森学院奥林商学院工商管理硕士学位, 以优异成绩毕业并获得巴布森奖学金。1992 年, 她以优异成绩获得中国哈尔滨理工大学科技英语学士学位。此外, 她还是特许金融分析师。
---------------------	--	--	---

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易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 2 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

全球组合 2020 上半年度绩效优于业绩比较基准，板块配置是相对绩效出色的主要原因。超配信息技术板块以及低配能源和金融板块实现了增值。选股对回报带来了正面贡献。在金融和通信服务板块的选股表现强劲，但被必需消费品板块不利的选股表现部分抵销。

2020 年初时，GCI 有所改善，我们预计经济增长将出现积极转变。但新冠肺炎疫情在全球蔓延导致经济增长停滞，各国政府控制疫情的举措使得经济活动放缓。由于经济活动减少的幅度和持续时间、能源市场崩溃以及欧洲和美国信用恶化等问题引发担忧，市场做出反应。我们就近期经济衰退作出指引，因此我们转而增加质量和资本回报因素比重，减少增长和估值因素比重。我们认为全球经济复苏将取决于刺激措施、病毒控制以及抗病毒治疗或疫苗研发的进展。事实上，亚洲一些国家的部分经济活动正在恢复，当地疫情目前看来已得到较好控制。

在这样的环境中，我们已利用市场波动提升了投资组合的质量。我们继续聚焦于质量较高、增长较快、债务较少、资产负债状况更佳的个股，这些公司为未来增长做好了准备。与此同时，我们一直遵循严谨的投资流程，卖出了基本面恶化的公司，以及由于经济增长停滞而有可能下调盈利预期的公司。

中国组合 2020 上半年度绩效优于业绩比较基准，选股是相对绩效出色的主要原因。在医疗、通信服务和非必需消费品板块的选股表现强劲。板块配置也提升了回报。我们超配医疗和通信服务以及低配金融板块带来了正面贡献，但部分被低配必需消费品板块造成的负面影响所抵销。

我们认为短期内市场波动将持续，因为中美地缘政治关系恶化，以及主要经济体在遏制新冠病毒传播方面的有效程度成为股市的主要推动因素。我们认为，无论经济增长水平如何，那些拥有强劲内生收入推动力并受到长期趋势支撑的公司在经济周期中将更具韧性。中国的宏观经济数据已开始显示商业活动在缓慢但稳定地复苏。此外，我们看到一些发达经济体取得进展，患病人数呈下降趋势。未来结果的范围可能仍然很广，但可见度有所提高。我们仍然认为，债务水平较低、业务模式较强的优质公司将能够在这一严峻时期变得更强大和获得市场份额。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 10.37%，业绩比较基准收益率为-0.25%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年第 2 季度，全球股市(+18.4%)创 1999 年 12 月以来最高季度涨幅。投资者对新冠病毒疫苗初期试验取得成功持乐观态度，财政和货币刺激持续，以及有迹象显示全球经济活动正在改善，均为市场提供了支撑。随着大部分国家新感染病例下降，各国政府将重点转向逐步解除封锁限制以及为本国经济复苏提供支持；但美国一些地区新确诊病例急剧上升，印度和拉丁美洲大部分地区的疫情似乎难以控制。欧盟委员会公布了一项 7,500 亿欧元的复苏基金计划，为遭受新冠疫情重创的欧元区经济体提供拨款和贷款。季中，美中贸易摩擦升级；中国决定实施香港国安法引起争议，招致美国不利回应措施，同时也加剧了市场对香港作为全球金融中心的未来的担忧。二季度，油价继 4 月份疫情导致需求锐减而跌至历史低点后回升，因为全球经济开始复苏。

我们认为市场仍处于极不稳定的状态，因为中美地缘政治关系恶化以及第二波新冠疫情可能再度爆发，继续推动着消息面风险。由于不确定性增加，短期内各种可能出现的结果和波动将主要取决于一些关键的地缘政治事件，包括美国即将进行总统选举、香港实施《国安法》以及中印边界冲突升级。虽然近期可能存在负面因素，但我们仍然相信，尽管未来面临低增长环境，那些受建设性长期趋势和内生收入驱动因素支撑的公司在经济周期中将较具韧性。我们认为，债务水平较低、经营模式稳健的优质公司在这一严峻时期能够变得更强大和赢得市场份额。

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，本基金实施利润分配的金额为 101,350,052.32 元，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	72,738,559.63	95,673,306.53
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	986,561,394.70	718,227,892.79
其中：股票投资		986,561,394.70	718,227,892.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,037,145.77	1,493,184.85
应收利息	6.4.7.5	5,436.94	20,996.70
应收股利		1,135,513.24	134,836.90
应收申购款		30,424,741.31	75,023,837.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	6,037,062.88	1,493,037.19
资产总计		1,102,939,854.47	892,067,092.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		41,882,537.88	11,239,871.21
应付管理人报酬		1,485,984.99	1,176,310.69
应付托管费		247,664.13	196,051.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	6,278,787.98	1,718,213.19
负债合计		49,894,974.98	14,330,446.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	680,716,737.96	559,679,113.36
未分配利润	6.4.7.10	372,328,141.53	318,057,532.63
所有者权益合计		1,053,044,879.49	877,736,645.99
负债和所有者权益总计		1,102,939,854.47	892,067,092.87

注：1、本基金基金合同生效日为 2008 年 2 月 14 日。

2、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.547 元，基金份额总额为 680,716,737.96 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		100,470,929.32	86,981,594.01
1. 利息收入		253,975.98	144,247.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	253,975.98	144,247.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,169,955.71	11,645,284.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,920,815.55	8,174,415.93
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	77,121.01	58,540.97
股利收益	6.4.7.17	5,172,019.15	3,412,327.63

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	67,100,518.04	75,011,467.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		777,429.78	-169,246.13
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,169,049.81	349,840.59
减：二、费用		10,743,410.51	5,966,057.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,453,547.68	4,762,079.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,408,924.60	793,680.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	758,608.07	292,138.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	122,330.16	118,159.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		89,727,518.81	81,015,536.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		89,727,518.81	81,015,536.46

注：本基金基金合同生效日为 2008 年 2 月 14 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	559,679,113.36	318,057,532.63	877,736,645.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	89,727,518.81	89,727,518.81
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）	121,037,624.60	65,893,142.41	186,930,767.01
其中：1. 基金申	742,750,868.76	309,364,077.74	1,052,114,946.50

购款			
2. 基金赎回款	-621,713,244.16	-243,470,935.33	-865,184,179.49
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）	-	-101,350,052.32	-101,350,052.32
五、期末所有者权益（基金净值）	680,716,737.96	372,328,141.53	1,053,044,879.49
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	363,776,662.21	72,023,766.38	435,800,428.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	81,015,536.46	81,015,536.46
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）	40,926,908.93	12,234,524.21	53,161,433.14
其中：1. 基金申购款	209,932,161.55	69,957,904.42	279,890,065.97
2. 基金赎回款	-169,005,252.62	-57,723,380.21	-226,728,632.83
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）	404,703,571.14	165,273,827.05	569,977,398.19

注：本基金基金合同生效日为 2008 年 2 月 14 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中国机会全球配置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”）证监基金字[2007]325 号文《关于同意工银瑞信中国机会全球配置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 2008 年 2 月 14 日正式生效，首次设立募集规模为 3,155,816,636.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为美国花旗银行有限公司（Citibank N.A），境外投资顾问为威灵顿管理有限责任合伙制公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，以及政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具。其中，投资于香港等境外证券市场上市的中国公司股票的资产为中国公司组合，投资于全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票的资产为全球公司组合，中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%。本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 60%，政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具占基金资产的比例不高于 40%。本基金的业绩比较基准为： $40\% \times \text{MSCI 中国指数收益率} + 60\% \times \text{MSCI 全球股票指数收益率}$ 。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	72,738,559.63
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	72,738,559.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	744,763,965.00	986,561,394.70	241,797,429.70
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	744,763,965.00	986,561,394.70	241,797,429.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,436.94
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	—
合计	5,436.94

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	6,037,062.88
待摊费用	—
合计	6,037,062.88

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	147,160.55
应付证券出借违约金	—
预提审计费	34,809.32
其他应付款	6,037,145.77
预提信息披露费	59,672.34
合计	6,278,787.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	559,679,113.36	559,679,113.36
本期申购	742,750,868.76	742,750,868.76
本期赎回（以“-”号填列）	-621,713,244.16	-621,713,244.16
- 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	680,716,737.96	680,716,737.96

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

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	190,239,537.91	127,817,994.72	318,057,532.63
本期利润	22,627,000.77	67,100,518.04	89,727,518.81
本期基金份额交易产生的变动数	25,789,828.76	40,103,313.65	65,893,142.41
其中：基金申购款	145,436,378.27	163,927,699.47	309,364,077.74
基金赎回款	-119,646,549.51	-123,824,385.82	-243,470,935.33
本期已分配利润	-101,350,052.32	-	-101,350,052.32
本期末	137,306,315.12	235,021,826.41	372,328,141.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		253,975.98
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		-
其他		-
合计		253,975.98

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,920,815.55
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	25,920,815.55

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	483,408,560.28
减：卖出股票成本总额	457,487,744.73
买卖股票差价收入	25,920,815.55

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	77,121.01
减：卖出权证成本总额	—
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	—
买卖权证差价收入	77,121.01

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,172,019.15
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	5,172,019.15

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	67,100,518.04
股票投资	67,100,518.04
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	67,100,518.04

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,169,049.81
合计	1,169,049.81

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	758,608.07
银行间市场交易费用	—
合计	758,608.07

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行费用	15,649.24
其他	12,199.26
合计	122,330.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
美国花旗银行有限公司	境外资产托管人
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
威灵顿管理有限责任合伙制公司	境外投资顾问

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
美国花旗银行有限公司	39,484,952.20	3.46	29,256,549.99	6.98
瑞士信贷银行股份有限公司	125,741,767.48	11.01	16,845,205.56	4.02

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

瑞士信贷银行股份有限公司	35,728.67	11.49	-	-
美国花旗银行有限公司	19,941.85	6.41	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
瑞士信贷银行股份有限公司	7,491.99	5.56	-	-
美国花旗银行有限公司	13,854.42	10.28	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。

2、该类佣金协议的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,453,547.68	4,762,079.98
其中：支付销售机构的客户维护费	2,733,031.74	1,310,042.18

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

$$H=E \times 1.8\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一估值日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	1,408,924.60	793,680.06
----------------	--------------	------------

注：1、基金托管费按前一估值日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一估值日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
美国花旗银行有限公司	12,172,280.45	15,193.55	5,248,268.14	28,625.56
中国银行股份有限公司	60,566,279.18	238,782.43	35,333,198.60	115,621.59

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，利息收入（本期）仅为活期存款利息收入；

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

3、本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国银行股份有限公司和基金境外资产托管人美国花旗银行有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 1 月 14 日	-	2020 年 1 月 13 日	1.700	66,655,558.34	34,694,493.98	101,350,052.32	-
合计	-	-	-	1.700	66,655,558.34	34,694,493.98	101,350,052.32	-

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关

联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施。在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策，公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将持有一些期限在一年以内的政府债券、回购等货币市场工具。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	72,738,559.63	-	-	-	-	-	72,738,559.63
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	986,561,394.70	986,561,394.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,037,145.77	6,037,145.77
应收利息	-	-	-	-	-	5,436.94	5,436.94
应收股利	-	-	-	-	-	1,135,513.24	1,135,513.24
应收申购款	-	-	-	-	-	30,424,741.31	30,424,741.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	6,037,062.88	6,037,062.88
资产总计	72,738,559.63	-	-	-	-	1,030,201,294.84	1,102,939,854.47
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,882,537.88	41,882,537.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,485,984.99	1,485,984.99
应付托管费	-	-	-	-	-	247,664.13	247,664.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	6,278,787.98	6,278,787.98
负债总计	-	-	-	-	-	49,894,974.98	49,894,974.98
利率敏感度缺口	72,738,559.63	-	-	-	-	980,306,319.86	1,053,044,879.49
上年度末 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	95,673,306.53	-	-	-	-	-	95,673,306.53
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	718,227,892.79	718,227,892.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,493,184.85	1,493,184.85
应收利息	-	-	-	-	-	20,996.70	20,996.70
应收股利	-	-	-	-	-	134,836.90	134,836.90
应收申购款	-	-	-	-	-	75,023,837.91	75,023,837.91
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	1,493,037.19	1,493,037.19

资产总计	95,673,306.53	-	-	-	-	796,393,786.34	892,067,092.87
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,239,871.21	11,239,871.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,176,310.69	1,176,310.69
应付托管费	-	-	-	-	-	196,051.79	196,051.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,718,213.19	1,718,213.19
负债总计	-	-	-	-	-	14,330,446.88	14,330,446.88
利率敏感度缺口	95,673,306.53	-	-	-	-	782,063,339.46	877,736,645.99

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日						
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	欧元 折合人民币 元	瑞士法郎 折合人民币 元	日元 折合人民币 元	其他币种 折合人民币 元	合计
以外币计价的资产			-	-	-		
银行存款	12,169,372.01	0.02	4,186.13	-	-	-	12,173,558.16
交易性金融资产	551,699,411.78	288,761,531.60	51,425,054.48	41,333,523.46	25,946,172.81	27,395,700.57	986,561,394.70
应收利息	69.03	-	-	-	-	-	69.03
应收股利	179,611.23	955,902.01	-	-	-	-	1,135,513.24
应收证券清算款	-	6,037,145.77	-	-	-	-	6,037,145.77
其他应收款	6,037,062.88	-	-	-	-	-	6,037,062.88
资产合计	570,085,526.93	295,754,579.40	51,429,240.61	41,333,523.46	25,946,172.81	27,395,700.57	1,011,944,743.78
以外币计价的负债			-	-	-		
其他应付款	-	6,037,145.77	-	-	-	-	6,037,145.77
负债合计	-	6,037,145.77	-	-	-	-	6,037,145.77
资产负债表外汇风险敞	570,085,526.93	289,717,433.63	51,429,240.61	41,333,523.46	25,946,172.81	27,395,700.57	1,005,907,598.01

口净额							
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日						
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	欧元 折合人民币 元	英镑 折合人民币 元	瑞士法郎 折合人民币 元	其他币种 折合人民币 元	合计
以外 币计 价的 资产			-	-	-		
银行 存款	9,578,693.17	-	17.74	-	-	-	9,578,710.91
交易 性金 融资 产	424,815,468.73	199,276,369.59	37,233,355.94	21,598,349.06	20,912,928.31	14,391,421.16	718,227,892.79
应收 利息	2,954.28	-	-	-	-	-	2,954.28
应收 股利	134,836.90	-	-	-	-	-	134,836.90
应收 证券 清算 款	-	1,493,184.85	-	-	-	-	1,493,184.85
其他 应收 款	1,493,037.19	-	-	-	-	-	1,493,037.19
资产 合计	436,024,990.27	200,769,554.44	37,233,373.68	21,598,349.06	20,912,928.31	14,391,421.16	730,930,616.92
以外 币计 价的 负债			-	-	-		
其他 应付 款	-	1,493,184.85	-	-	-	-	1,493,184.85
负债 合计	-	1,493,184.85	-	-	-	-	1,493,184.85
资产 负债 表外 汇风 险敞	436,024,990.27	199,276,369.59	37,233,373.68	21,598,349.06	20,912,928.31	14,391,421.16	729,437,432.07

口净额							
-----	--	--	--	--	--	--	--

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除本基金的单一外币汇率变化 5%以外的其他市场变量保持不变,且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	美元相对人民币升值 5%	28,504,276.35	21,801,249.51
	美元相对人民币贬值 5%	-28,504,276.35	-21,801,249.51
	港币相对人民币升值 5%	14,485,871.68	9,963,818.48
	港币相对人民币贬值 5%	-14,485,871.68	-9,963,818.48
	欧元相对人民币升值 5%	2,571,462.03	1,861,668.68
	欧元相对人民币贬值 5%	-2,571,462.03	-1,861,668.68
	瑞士法郎相对人民币升值 5%	2,066,676.17	1,045,646.42
	瑞士法郎相对人民币贬值 5%	-2,066,676.17	-1,045,646.42
	日元相对人民币升值 5%	1,297,308.64	-
	日元相对人民币贬值 5%	-1,297,308.64	-

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

2、标记“-”处，表示当年该币种的汇率风险较小。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括：在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，以及政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	986,561,394.70	93.69	718,227,892.79	81.83
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	986,561,394.70	93.69	718,227,892.79	81.83

注：本基金持有的股票等权益类资产占基金资产的比例不低于 60%。其中，投资于香港等境外证券市场上市的中国公司股票的资产为中国公司组合，投资于全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票的资产为全球公司组合，中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；

	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出,反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准增加 5%	50,130,226.68	43,206,334.29
	业绩比较基准减少 5%	-50,130,226.68	-43,206,334.29

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

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	986,561,394.70	89.45
	其中: 普通股	851,270,707.39	77.18
	存托凭证	135,290,687.31	12.27
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中: 债券	—	—
	资产支持证券	—	—

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	72,738,559.63	6.59
8	其他各项资产	43,639,900.14	3.96
9	合计	1,102,939,854.47	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。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	551,699,411.78	52.39
中国香港	288,761,531.60	27.42
瑞士	41,333,523.46	3.93
法国	28,356,493.92	2.69
日本	25,946,172.81	2.46
荷兰	15,785,311.70	1.50
英国	14,952,764.19	1.42
西班牙	7,283,248.86	0.69
加拿大	6,533,670.23	0.62
瑞典	5,909,266.15	0.56
合计	986,561,394.70	93.69

注：1、权益投资的国家类别根据其所在证券交易所确定；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术 Information Technology	257,195,742.10	24.42
非必需消费品 Consumer Discretionary	201,910,392.43	19.17
通信服务 Communication Services	200,194,755.20	19.01
保健 Health Care	158,404,099.60	15.04
工业 Industrials	66,909,870.79	6.35

金融 Financials	54,376,930.54	5.16
必需消费品 Consumer Staples	19,212,808.08	1.82
公用事业 Utilities	9,828,734.24	0.93
能源 Energy	7,920,747.64	0.75
材料 Materials	7,292,735.86	0.69
房地产 Real Estate	3,314,578.22	0.31
合计	986,561,394.70	93.69

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	227,211	103,481,246.86	9.83
2	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	US01609W1027	纽约证券交易所	美国	40,240	61,448,417.56	5.84
			KYG017191142	香港证券交易所	中国香港	70,800	13,555,157.30	1.29
3	Meituan Dianping	美团点评	KYG596691041	香港证券交易所	中国香港	207,697	32,612,652.73	3.10
4	Apple Inc	苹果公司	US0378331005	纳斯达克证券交易所	美国	11,287	29,149,824.26	2.77
5	Microsoft Corp	微软	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	18,012	25,950,771.80	2.46

				所				
6	Amazon.com Inc	亚马逊公司	US0231351067	纳斯达克 证券交易所	美国	1,090	21,288,862.15	2.02
7	NetEase Inc	网易	US64110W1027	纳斯达克 证券交易所	美国	6,068	18,445,480.37	1.75
8	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇 光学 科技	KYG8586D1097	香港 证券 交易所	中国 香港	153,842	17,425,154.12	1.65
9	Alphabet Inc	-	US02079K1079	纳斯达克 证券交易所	美国	1,731	17,323,245.60	1.65
10	Facebook Inc	-	US30303M1027	纳斯达克 证券交易所	美国	8,986	14,445,373.00	1.37
11	Kingdee International Software Group Co Ltd	金蝶 国际	KYG525681477	香港 证券 交易所	中国 香港	819,087	13,482,326.66	1.28
12	Tencent Music Entertainment Group	-	US88034P1093	纽约 证券 交易所	美国	126,921	12,094,310.97	1.15
13	Zai Lab Ltd	-	US98887Q1040	纳斯达克 证券交易所	美国	20,464	11,898,574.55	1.13
14	UnitedHealth Group Inc	联合 健康	US91324P1021	纽约 证券 交易所	美国	5,449	11,378,048.86	1.08
15	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港 交易所	HK0388045442	香港 证券 交易所	中国 香港	36,406	10,974,049.89	1.04

				所				
16	Pharmaron Beijing Co Ltd	康龙化成	CNE100003PG4	香港证券交易所	中国香港	143,800	10,508,213.76	1.00
17	Adobe Inc	奥多比	US00724F1012	纳斯达克证券交易所	美国	3,335	10,277,726.78	0.98
18	Home Depot Inc/The	家得宝	US4370761029	纽约证券交易所	美国	5,773	10,238,332.05	0.97
19	Nestle SA	雀巢	CH0038863350	瑞士证券交易所	瑞士	12,689	9,892,619.95	0.94
20	Visa Inc	维萨公司	US92826C8394	纽约证券交易所	美国	7,204	9,851,808.70	0.94
21	CanSino Biologics Inc	康希诺生物	CNE100003F01	香港证券交易所	中国香港	50,341	9,831,268.67	0.93
22	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能源	KYG3066L1014	香港证券交易所	中国香港	123,396	9,828,734.24	0.93
23	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	NL0010273215	泛欧阿姆斯特丹交易所	荷兰	3,665	9,537,982.55	0.91
24	Netflix Inc	奈飞公司	US64110L1061	纳斯达克证券交易所	美国	2,920	9,406,650.59	0.89
25	Roche Holding AG	罗氏	CH0012032048	瑞士证券交易所	瑞士	3,791	9,265,357.12	0.88
26	Eli Lilly and Co	礼来	US5324571083	纽约	美国	7,769	9,030,004.34	0.86

				证 券 交 易 所				
27	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	US57636Q1040	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,257	8,911,638.49	0.85
28	PayPal Holdings Inc	-	US70450Y1038	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	7,181	8,857,485.49	0.84
29	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	US8740391003	纽 约 证 券 交 易 所	美国	21,914	8,807,307.05	0.84
30	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	GB0009895292	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	11,982	8,792,866.37	0.83
31	salesforce.com Inc	-	US79466L3024	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,392	8,477,087.88	0.81
32	Novartis AG	诺华	CH0012005267	瑞 士 证 券 交 易 所	瑞士	13,326	8,175,301.48	0.78
33	Fidelity National Information Services Inc	繁德信息技术有限公司	US31620M1062	纽 约 证 券 交 易 所	美国	8,560	8,125,923.73	0.77
34	Teradyne Inc	泰瑞达	US8807701029	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	13,303	7,959,032.51	0.76
35	China Oilfield Services Ltd	中海油服	CNE1000002P4	香 港 证 券 交 易 所	中国香港	1,245,882	7,920,747.64	0.75
36	Galaxy	银河	HK0027032686	香 港	中国	163,000	7,853,985.48	0.75

	Entertainment Group Ltd	娱乐		证 券 交 易 所	香港			
37	Global Payments Inc	环汇有限公司	US37940X1028	纽 约 证 券 交 易 所	美国	6,491	7,794,553.71	0.74
38	Accenture PLC	埃森哲公司	IE00B4BNMY34	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,042	7,664,395.83	0.73
39	Charter Communications Inc	查特通信公司	US16119P1084	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	2,114	7,633,290.77	0.72
40	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	-	FR0000121014	法 国 证 券 交 易 所	法国	2,433	7,563,638.63	0.72
41	Partners Group Holding AG	-	CH0024608827	瑞 士 证 券 交 易 所	瑞士	1,180	7,548,292.39	0.72
42	Agilent Technologies Inc	安捷伦	US00846U1016	纽 约 证 券 交 易 所	美国	11,959	7,481,734.75	0.71
43	Texas Instruments Inc	德州仪器	US8825081040	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	8,323	7,481,412.49	0.71
44	Progressive Corp/The	前进保险公司	US7433151039	纽 约 证 券 交 易 所	美国	13,190	7,480,560.05	0.71
45	Lockheed Martin Corp	洛克希德马丁	US5398301094	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,855	7,375,753.00	0.70
46	Schneider Electric SE	施耐德电气股份公	FR0000121972	法 国 证 券 交 易 所	法国	9,368	7,374,336.71	0.70

		司						
47	Huazhu Group Ltd	华住酒店集团有限公司	US44332N1063	纳斯达克证券交易所	美国	29,717	7,373,871.63	0.70
48	Danaher Corp	丹纳赫	US2358511028	纽约证券交易所	美国	5,871	7,349,716.94	0.70
49	Cellnex Telecom SA	-	ES0105066007	西班牙证券交易所	西班牙	16,867	7,283,248.86	0.69
50	KLA Corp	-	US4824801009	纳斯达克证券交易所	美国	5,277	7,265,485.26	0.69
51	Worldline SA/France	-	FR0011981968	法国证券交易所	法国	11,805	7,243,947.95	0.69
52	China Meidong Auto Holdings Ltd	美东汽车	KYG211921021	香港证券交易所	中国香港	414,000	7,185,119.04	0.68
53	FleetCor Technologies Inc	-	US3390411052	纽约证券交易所	美国	4,031	7,178,028.45	0.68
54	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	US92532F1003	纳斯达克证券交易所	美国	3,408	7,004,290.79	0.67
55	Tokyo Electron Ltd	东京电子	JP3571400005	日本证券交易所	日本	4,020	6,994,653.35	0.66
56	Intuit Inc	-	US4612021034	纳斯达克证券交易所	美国	3,334	6,990,988.27	0.66

57	Baxter International Inc	百特	US0718131099	纽 约 证 券 交 易 所	美国	11,436	6,970,756.05	0.66
58	Keyence Corp	-	JP3236200006	日 本 证 券 交 易 所	日本	2,300	6,815,668.75	0.65
59	Marvell Technology Group Ltd	-	BMG5876H1051	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	27,433	6,809,070.04	0.65
60	BlackRock Inc	贝莱德有限公司	US09247X1019	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,741	6,706,132.05	0.64
61	Anthem Inc	-	US0367521038	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,586	6,676,296.14	0.63
62	CDW Corp/DE	-	US12514G1085	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	7,994	6,575,035.50	0.62
63	Electronic Arts Inc	电子艺界	US2855121099	纳 斯 克 证 券 交 易 所	美国	7,000	6,543,935.83	0.62
64	Dollarama Inc	-	CA25675T1075	多 伦 多 证 券 交 易 所	加拿大	27,907	6,533,670.23	0.62
65	Kuehne + Nagel International AG	德讯国际股份有限公司	CH0025238863	瑞 士 证 券 交 易 所	瑞士	5,507	6,451,952.52	0.61
66	Humana Inc	-	US4448591028	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,312	6,346,616.00	0.60
67	TJX Cos Inc/The	-	US8725401090	纽 约 证 券 交 易 所	美国	17,558	6,284,702.09	0.60

				证 券 交 易 所				
68	Sino Biopharmaceutical Ltd	中国 生物 制药	KYG8167W1380	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	471,224	6,284,348.82	0.60
69	Fortive Corp	福迪 威公 司	US34959J1088	纽 约 证 券 交 易 所	美国	13,087	6,268,659.52	0.60
70	Wolters Kluwer NV	威科 集团	NL0000395903	泛 欧 阿 姆 斯 特 丹 交 易 所	荷兰	11,288	6,247,329.15	0.59
71	Northrop Grumman Corp	诺斯 洛普 格鲁 门公 司	US6668071029	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,862	6,229,204.48	0.59
72	Edenred	-	FR0010908533	法 国 证 券 交 易 所	法国	19,923	6,174,570.63	0.59
73	Experian PLC	益博 睿有 限公 司	GB00B19NLV48	英 国 伦 敦 证 券 交 易 所	英国	25,075	6,159,897.82	0.58
74	Hoya Corp	-	JP3837800006	日 本 证 券 交 易 所	日本	9,100	6,144,229.73	0.58
75	Blackstone Group Inc/The	-	US09260D1072	纽 约 证 券 交 易 所	美国	15,202	6,097,894.19	0.58
76	SMC Corp/Japan	-	JP3162600005	日 本 证 券 交 易 所	日本	1,650	5,991,620.98	0.57
77	Swedish Match AB	瑞典 火柴 公司	SE0000310336	瑞 典 证 券 交 易 所	瑞典	11,888	5,909,266.15	0.56

				所				
78	Ross Stores Inc	-	US7782961038	纳斯达克 证券交易所	美国	9,758	5,888,529.31	0.56
79	ICON PLC	-	IE0005711209	纳斯达克 证券交易所	美国	4,928	5,877,194.74	0.56
80	Equifax Inc	-	US2944291051	纽约 证券交易所	美国	4,807	5,849,275.18	0.56
81	TAL Education Group	好未来教育集团	US8740801043	纽约 证券交易所	美国	11,985	5,801,893.08	0.55
82	FMC Corp	-	US3024913036	纽约 证券交易所	美国	8,161	5,755,625.15	0.55
83	Ares Management Corp	阿瑞斯管理有限合伙企业	US03990B1017	纽约 证券交易所	美国	20,083	5,644,450.66	0.54
84	LPL Financial Holdings Inc	-	US50212V1008	纳斯达克 证券交易所	美国	10,092	5,601,391.02	0.53
85	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	石药集团	HK1093012172	香港 证券交易所	中国香港	415,120	5,551,300.80	0.53
86	TransUnion	环联 有限公司	US89400J1079	纽约 证券交易所	美国	8,955	5,518,068.13	0.52
87	Trip.com Group Ltd	携程集团有限	US89677Q1076	纳斯达克 证券	美国	29,832	5,474,191.09	0.52

		公司		交易所				
88	GoDaddy Inc	-	US3802371076	纽约证券交易所	美国	10,390	5,393,861.85	0.51
89	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	KYG970081090	香港证券交易所	中国香港	39,500	5,116,268.78	0.49
90	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿	CNE1000002L3	香港证券交易所	中国香港	303,457	4,324,160.29	0.41
91	Hutchison China Meditech Ltd	和黄中国医药科技有限公司	US44842L1035	纳斯达克证券交易所	美国	20,213	3,946,641.01	0.37
92	China Literature Ltd	阅文集团	KYG2121R1039	香港证券交易所	中国香港	74,200	3,537,972.35	0.34
93	Lonking Holdings Ltd	中国龙工	KYG5636C1078	香港证券交易所	中国香港	1,604,304	3,443,773.30	0.33
94	Yihai International Holding Ltd	颐海国际	KYG984191075	香港证券交易所	中国香港	47,000	3,410,921.98	0.32
95	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	HK0688002218	香港证券交易所	中国香港	154,741	3,314,578.22	0.31
96	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	CNE100003F19	香港证券交易所	中国香港	31,801	2,925,164.36	0.28
97	Haier Electronics Group Co Ltd	海尔电器	BMG423131256	香港证券交易所	中国香港	131,062	2,807,370.06	0.27
98	Innovent	信达	KYG4818G1010	香港	中国	35,221	1,849,905.54	0.18

	Biologics Inc	生物		证 券 交 易 所	香港			
99	Anhui Conch Cement Co Ltd	海螺水泥	CNE1000001W2	香 港 证 券 交 易 所	中国香港	32,237	1,537,110.71	0.15
100	China Metal Recycling Holdings Ltd	中国金属再生资源	KYG211311009	场外	中国香港	799,600	-	-

注：1、上表所用证券代码采用 ISIN 代码；

2、对于在不同市场上市的同一公司的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	KYG875721634	43,007,700.63	4.90
2	Alibaba Group Holding Ltd	US01609W1027	25,595,936.61	2.92
		KYG017191142	13,805,605.85	1.57
3	Amazon.com Inc	US0231351067	19,361,180.93	2.21
4	BlackRock Inc	US09247X1019	14,510,218.83	1.65
5	Anthem Inc	US0367521038	14,374,634.75	1.64
6	Roche Holding AG	CH0012032048	10,492,639.16	1.2
7	Meituan Dianping	KYG596691041	10,382,843.22	1.18
8	Ross Stores Inc	US7782961038	10,149,698.62	1.16
9	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	KYG8586D1097	9,657,174.26	1.1
10	Bank of America Corp	US0605051046	9,630,200.20	1.1
11	China Construction Bank Corp	CNE1000002H1	9,282,868.45	1.06
12	Apple Inc	US0378331005	9,104,831.73	1.04
13	Galaxy Entertainment Group Ltd	HK0027032686	8,285,882.49	0.94

14	Charter Communications Inc	US16119P1084	8,126,592.72	0.93
15	Netflix Inc	US64110L1061	8,105,419.54	0.92
16	Tencent Music Entertainment Group	US88034P1093	8,075,518.19	0.92
17	Danaher Corp	US2358511028	7,972,736.13	0.91
18	Industria de Diseno Textil SA	ES0148396007	7,649,609.87	0.87
19	China Oilfield Services Ltd	CNE1000002P4	7,327,984.67	0.83
20	Marvell Technology Group Ltd	BMG5876H1051	7302972.35	0.83

注：1、上表所用证券代码采用 ISIN 代码；

2、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；

3、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；

4、对于在不同市场上市的同一公司的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	China Construction Bank Corp	CNE1000002H1	28,790,191.93	3.28
2	Tencent Holdings Ltd	KYG875721634	20,888,742.85	2.38
3	Alibaba Group Holding Ltd	US01609W1027	14,544,740.25	1.66
		KYG017191142	3,126,994.03	0.36
4	GSX Techedu Inc	US36257Y1091	11,162,517.16	1.27
5	JPMorgan Chase & Co	US46625H1005	11,134,258.84	1.27
6	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	HK1093012172	10,724,995.52	1.22
7	BeiGene Ltd	US07725L1026	8,941,114.32	1.02
8	Abbott Laboratories	US0028241000	8,889,136.14	1.01
9	Medtronic PLC	IE00BTN1Y115	8,369,546.54	0.95

10	Bank of America Corp	US0605051046	8,253,878.43	0.94
11	Innovent Biologics Inc	KYG4818G1010	7,808,144.33	0.89
12	Meituan Dianping	KYG596691041	7,408,831.20	0.84
13	Becton Dickinson and Co	US0758871091	7,380,589.60	0.84
14	L3Harris Technologies Inc	US5024311095	7,209,281.58	0.82
15	Comcast Corp	US20030N1019	7,094,577.51	0.81
16	CanSino Biologics Inc	CNE100003F01	6,807,398.02	0.78
17	Ross Stores Inc	US7782961038	6,774,261.04	0.77
18	Automatic Data Processing Inc	US0530151036	6,735,054.89	0.77
19	Aon PLC	IE00BLP1HW54	6,627,184.00	0.76
20	Anthem Inc	US0367521038	6,509,257.42	0.74

注：1、上表所用证券代码采用 ISIN 代码；

2、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；

3、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；

4、对于在不同市场上市的同一公司的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	658,643,607.59
卖出收入（成交）总额	483,408,560.28

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1 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**

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

7.11.2 基金投资的前十名股票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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	6,037,145.77
3	应收股利	1,135,513.24
4	应收利息	5,436.94
5	应收申购款	30,424,741.31
6	其他应收款	6,037,062.88
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,639,900.14

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
285,093	2,387.70	11,233,526.57	1.65	669,483,211.39	98.35

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	548,500.48	0.08

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 2 月 14 日) 基金份额总额	3,155,816,636.00
本报告期期初基金份额总额	559,679,113.36
本报告期基金总申购份额	742,750,868.76
减：本报告期基金总赎回份额	621,713,244.16
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	680,716,737.96

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

基金管理人于 2020 年 2 月 22 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，马成先生自 2020 年 2 月 21 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
Credit Suisse Securities	—	125,741,767.48	11.01%	35,728.67	11.49%	—
Morgan	—	120,159,584.83	10.52%	43,572.14	14.01%	—

Stanley						
Goldman Sachs	-	118,090,466.21	10.34%	36,164.44	11.63%	-
Instinet	-	93,710,485.35	8.21%	16,571.45	5.33%	-
JP Morgan Chase	-	85,349,144.20	7.47%	31,276.73	10.06%	-
Merrill Lynch	-	62,882,734.94	5.51%	14,249.35	4.58%	-
UBS Securities	-	59,315,596.36	5.19%	18,066.55	5.81%	-
Cowen & Co	-	56,637,823.25	4.96%	6,520.79	2.10%	-
Wall Street Access/GLP	-	55,324,450.49	4.84%	2,901.09	0.93%	-
Barclays Capital	-	55,281,155.40	4.84%	5,273.56	1.70%	-
Sanford C Bernstein & Co	-	50,879,929.50	4.46%	10,253.52	3.30%	-
Jefferies & Company	-	48,922,566.64	4.28%	11,565.97	3.72%	-
Citigroup	-	39,484,952.20	3.46%	19,941.85	6.41%	-
Liquidnet, Inc.	-	35,808,780.20	3.14%	7,591.28	2.44%	-
Investment Technology Group	-	25,241,416.06	2.21%	8,506.44	2.74%	-
BTIG LLC	-	23,710,001.63	2.08%	11,652.43	3.75%	-
Exane	-	17,476,010.02	1.53%	4,911.47	1.58%	-
Credit Agricole/CLSA	-	15,207,585.35	1.33%	6,600.48	2.12%	-
RBC Capital Markets	-	11,820,204.38	1.03%	2,708.23	0.87%	-

Virtu Americas LLC	-	11,151,810.17	0.98%	505.37	0.16%	-
HSBC Securities	-	9,205,490.11	0.81%	9,637.29	3.10%	-
Bank of Montreal	-	6,375,964.79	0.56%	1,123.34	0.36%	-
Macquarie	-	4,336,103.49	0.38%	1,483.26	0.48%	-
ISI Group	-	2,959,259.02	0.26%	371.29	0.12%	-
Canaccord Genuity	-	2,435,487.03	0.21%	1,741.44	0.56%	-
Stuart Frankel	-	1,541,847.06	0.14%	154.21	0.05%	-
Wells Fargo Securities	-	803,531.44	0.07%	290.92	0.09%	-
Mizuho Securities	-	752,276.09	0.07%	799.13	0.26%	-
Berenberg Bank	-	477,075.28	0.04%	477.08	0.15%	-
Oppenheimer & Company Inc	-	463,589.87	0.04%	6.33	0.00%	-
Cantor Fitzgerald	-	357,340.12	0.03%	310.17	0.10%	-
Cuttone & Company	-	147,739.02	0.01%	6.89	0.00%	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets	-	-	-	-	-	-
BNP-Paribas	-	-	-	-	-	-

BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-
Blair, W&C	-	-	-	-	-	-
Bradesco	-	-	-	-	-	-
CAI/Cheuvreux	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-
Cabrera Capital	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-
China Renaissance Capital	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Desjardins Securities Inc	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Sec	-	-	-	-	-	-
Enam Securities	-	-	-	-	-	-

Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-
Execution Noble Ltd	-	-	-	-	-	-
Green Street Advisors	-	-	-	-	-	-
Guggenheim Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Height Securities LLC	-	-	-	-	-	-
ING Financial Mkt	-	-	-	-	-	-
IXIS Securities	-	-	-	-	-	-
Itau Securities Inc	-	-	-	-	-	-
JMP Securities	-	-	-	-	-	-
Jones Trading	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-
KeyBanc Capital Markets	-	-	-	-	-	-

Kim Eng Securities	-	-	-	-	-	-
Lazard Capital	-	-	-	-	-	-
Leerink Swann & Co	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-
Luminex Trading & Analytics	-	-	-	-	-	-
MKM Partners	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi UFJ Securities	-	-	-	-	-	-
Natixis SA	-	-	-	-	-	-
Needham & Co Inc	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities	-	-	-	-	-	-
Oddo	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-
Piper Jaffray Co	-	-	-	-	-	-
Pulse Trading	-	-	-	-	-	-
R W Baird	-	-	-	-	-	-
Raymond	-	-	-	-	-	-

James & Associates						
Redburn Partners LL	-	-	-	-	-	-
Renaissance Macro	-	-	-	-	-	-
SMBC Nikko Capital Mkrts	-	-	-	-	-	-
Santander Investment	-	-	-	-	-	-
Sidoti & Company LLC	-	-	-	-	-	-
Societe Generale	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-
State Street Global	-	-	-	-	-	-
Stephens Inc	-	-	-	-	-	-
Stifel Nicolaus & Co Inc	-	-	-	-	-	-
SunTrust Robinson Humphrey	-	-	-	-	-	-

TD Securities	-	-	-	-	-	-
Telsey Advisory Group LLC	-	-	-	-	-	-
Wedbush Securities, Inc	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-

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

(1) 选择标准：

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

(2) 选择程序

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

10.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Credit Suisse Securities	-	-	-	-	-	-	-	-

Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Cowen & Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Wall Street Access/GLP	-	-	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C Bernstein & Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies & Company	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-	-	-
Liquidnet, Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
Investment Technology Group	-	-	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Exane	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole/CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Virtu Americas LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of Montreal	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
ISI Group	-	-	-	-	-	-	-	-
Canaccord Genuity	-	-	-	-	-	-	-	-

Stuart Frankel	-	-	-	-	-	-	-	-
Wells Fargo Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Berenberg Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
Oppenheimer & Company Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
Cantor Fitzgerald	-	-	-	-	-	-	-	-
Cuttone & Company	-	-	-	-	-	-	-	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP-Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-
BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-	-	-
Blair, W&C	-	-	-	-	-	-	-	-
Bradesco	-	-	-	-	-	-	-	-
CAI/Chevroux	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
Cabrera Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Desjardins	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities Inc								
Deutsche Bank Sec	-	-	-	-	-	-	-	-
Enam Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Execution Noble Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Green Street Advisors	-	-	-	-	-	-	-	-
Guggenheim Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Height Securities LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
ING Financial Mkt	-	-	-	-	-	-	-	-
IXIS Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Itau Securities Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
JMP Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Jones Trading	-	-	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-	-	-
KeyBanc Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Kim Eng Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Lazard Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Leerink Swann & Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-	-	-
Luminex	-	-	-	-	-	-	-	-

Trading & Analytics								
MKM Partners	-	-	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi UFJ Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Natixis SA	-	-	-	-	-	-	-	-
Needham & Co Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Oddo	-	-	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-	-	-
Piper Jaffray Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Pulse Trading	-	-	-	-	-	-	-	-
R W Baird	-	-	-	-	-	-	-	-
Raymond James & Associates	-	-	-	-	-	-	-	-
Redburn Partners LL	-	-	-	-	-	-	-	-
Renaissance Macro	-	-	-	-	-	-	-	-
SMBC Nikko Capital Mkrt	-	-	-	-	-	-	-	-
Santander Investment	-	-	-	-	-	-	-	-
Sidoti & Company LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Societe Generale	-	-	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Global	-	-	-	-	-	-	-	-
Stephens Inc	-	-	-	-	-	-	-	-

Stifel Nicolaus & Co Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
SunTrust Robinson Humphrey	-	-	-	-	-	-	-	-
TD Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Telsey Advisory Group LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Wedbush Securities, Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于限制工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金机构投资者大额申购、定期定额投资业务金额的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 7 日
2	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金 2019 年第一次分红公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 10 日
3	关于恢复工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金机构投资者大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 21 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金春节假期延长期间交易规则的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 29 日
5	关于调整旗下部分基金在直销电子交易系统最低定期定额投资金额及最低转换份额的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 2 月 14 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 2 月 22 日
7	关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 25 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 26 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于终止中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 26 日

10	工银瑞信基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 11 日
----	---	------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日