

# 工银瑞信全球精选股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38

7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	38
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 .....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
7.11 投资组合报告附注 .....	46
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信全球精选股票型证券投资基金
基金简称	工银全球精选股票(QDII)
基金主代码	486002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月25日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	137,407,318.13份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制基金资产风险的基础上,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过在全球范围内采用“自上而下”方法进行国家及地区的资产配置,综合运用定性和定量分析方法精选全球股票,并且在全球范围内进行投资组合风险收益优化,追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	MSCI 世界指数总收益。
风险收益特征	本基金是投资于全球资本市场的股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金,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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	王小飞
	联系电话	400-811-9999	021-60637103
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-811-9999	021-60637228
传真		010-66583158	021-60635778
注册地址		北京市西城区金融大街5号、甲5号9层甲5号901	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		赵桂才	田国立

### 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	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	威灵顿管理有限责任合伙制公司	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA

办公地址	280 Congress Street, Boston, MA, USA	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码	2210	NY 10286

注：威灵顿管理有限责任合伙制公司自 2012 年 9 月 7 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,256,345.36
本期利润	57,671,851.36
加权平均基金份额本期利润	0.3992
本期加权平均净值利润率	14.43%
本期基金份额净值增长率	15.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	208,614,153.69
期末可供分配基金份额利润	1.5182
期末基金资产净值	420,767,610.48
期末基金份额净值	3.062
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	206.20%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

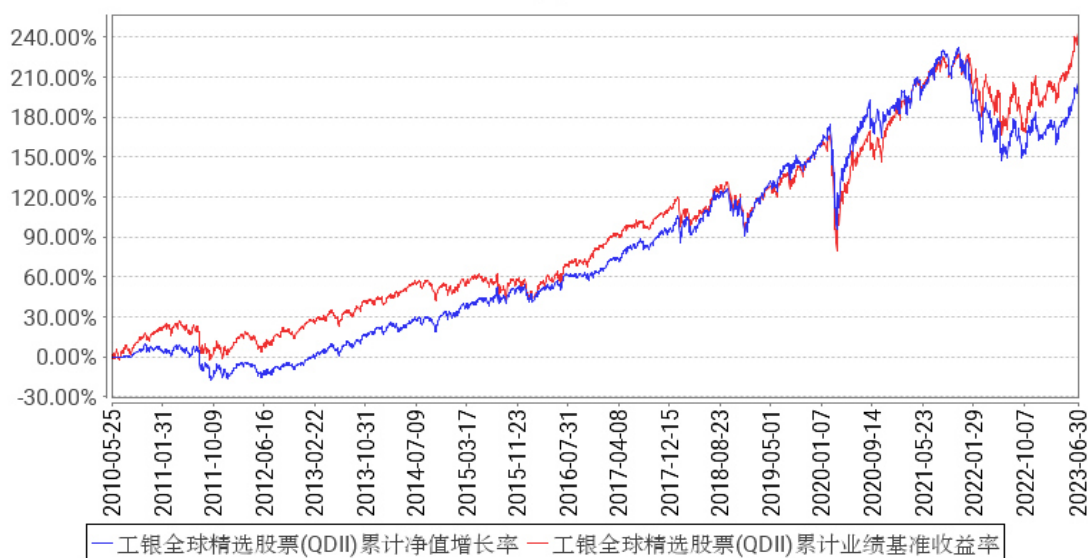
## 3.2 基金净值表现

### 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	7.70%	0.73%	7.95%	0.65%	-0.25%	0.08%
过去三个月	11.87%	0.75%	11.65%	0.73%	0.22%	0.02%
过去六个月	15.33%	0.82%	18.21%	0.82%	-2.88%	0.00%
过去一年	20.46%	0.96%	25.46%	1.01%	-5.00%	-0.05%
过去三年	15.55%	1.05%	39.55%	0.98%	-24.00%	0.07%
自基金合同生效起至今	206.20%	0.98%	243.02%	0.98%	-36.82%	0.00%

### 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

工银全球精选股票(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、本基金基金合同于 2010 年 05 月 25 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的规定。

## 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

工银瑞信基金管理有限公司是由中国工商银行绝对控股、独立运营的基金公司，工商银行拥有 80% 股权，瑞士信贷拥有 20% 股权。目前，公司在北京、上海、深圳等地设有分公司，分别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。

自 2005 年 6 月成立以来，公司坚持“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，立足专业化、综合化、国际化、数字化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资、绿色投资、责任投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。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、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、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII、公募基金投顾等多项业务资格，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。

工银瑞信(含子公司)以持续优秀的投资业绩、完善周到的服务，为逾 8500 万境内外个人和机构投资者提供涵盖公募与私募、上市与非上市、境内与跨境业务的财富管理服务，赢得了广大基金投资人、企业年金客户、私募资产管理计划客户等的认可和信赖。截至 2023 年 6 月 30 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 238 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模超过 1.7 万亿元，养老金管理规模居行业领先。

#### 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		
林念	专户投资部副总经理、本基金的基金经理	2020 年 12 月 21 日	-	10 年	博士研究生。曾任光大证券宏观分析师；2014 年加入工银瑞信，现任专户投资部副总经理、基金经理。2016 年 9 月 27 日至今，担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理；2020 年 12 月 21 日至今，担任工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金经理；2022 年 3 月 4 日至今，担任工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金经



					理；2022 年 8 月 1 日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 11 日至今，担任工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023 年 1 月 17 日至今，担任工银瑞信恒嘉一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》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	投资组合经理	38 年	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。

注：威灵顿管理有限责任合伙制公司自 2012 年 9 月 7 日起，担任本基金的境外投资顾问。

#### 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未发生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。

### 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

投资组合 2023 上半年度业绩逊于指数。选股是相对业绩滞后的主要原因。我们在信息技术和非必需消费品板块的选股表现欠佳，但部分被工业板块选股的正面表现所弥补。我们低配能源和必需消费品板块配置带来了正面贡献。

第二季度全球市场总体上涨。尽管宏观不确定性依然存在，但近期通胀仍有回落空间，基本面似乎也支持第三季度的持续增长。尽管如此，美国通胀率重返 2%的道路可能并不平坦。服务业依然强劲，并有可能在更长时间内保持高位，在短期内给投资者带来惊喜，并促使央行在 2023 年下半年采取进一步行动。如果出现经济衰退，最有可能是 2024 年，我们预计届时利率将开始下降。

#### 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 15.33%，业绩比较基准收益率为 18.21%。

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第二季度全球股市上扬。尽管有地缘政治不稳定、通胀加剧、信贷条件收紧以及利率快速上升等不利因素，全球经济和劳动力市场仍保持韧性。能源价格回落，有助于大多数国家的整体通胀率下降，从而缓解了家庭和企业的压力。然而，核心消费者价格持续高企给各国央行带来了需要在更长时间内保持高利率的压力——美联储、欧洲央行和英国央行的领导们重申降低通胀需要进一步收紧政策，这表明降低通胀可以在不引发衰退的情况下实现。中国经济数据欠佳，引发了人们对中国疫情后复苏持久性的担忧，增加了政策制定者提供更多实质性刺激措施的压力。对日本股市日益看涨的看法推动日经指数升至数十年高点，这得益于盈利和估值有利、公司治理改善、货币政策具有支持性，以及日本经济增长势头正在增强的迹象越来越多。在德国，第一季度 GDP

数据下调表明这个欧洲第一大国正处于衰退之中。为了提振油价，沙特阿拉伯计划 7 月份将石油日产量削减 100 万桶。不久前公布的一项更广泛的欧佩克+协议将限制供应至 2024 年。

第二季度中国股市有所回落。因为市场参与者对宏观经济数据走软、疫情后复苏放缓以及制造业低迷持谨慎态度。不过，我们继续对中国股市持谨慎乐观的看法。一方面，股市已经消化了相当多的负面消息，包括中国不同地区的复苏道路不均衡、美中地缘政治紧张局势加剧以及国内宏观环境走弱。另一方面，中国股市目前处于历史估值水平的相对底端，与其他风险资产相比具有吸引力。在中国央行最近将短期和中期贷款利率下调 10 个基点之后，我们看到了政策制定者采取刺激措施来应对中国经济放缓的意愿正在加强的早期迹象。尽管市场波动较大，但我们的重点维持不变，仍然是寻找那些内生增长前景强劲、资本回报较高且可持续以及公司治理良好的公司。

#### 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，原则上为运作部、投研部门（研究部或固定收益部）、风险管理部、法律合规部的部门负责人构成，组长由运作部负责人担任。

如遇相关部门负责人无法参与小组会议的情况，由其指定相关人员代为履行职责。

###### （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

投资经理可发起并参与所管理组合持仓证券的风险事件的估值讨论，但不得参与决策。

##### 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

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	31,127,881.91	21,837,250.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	393,974,777.41	369,499,425.51
其中：股票投资		393,974,777.41	369,499,425.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		504,649.29	2,441,254.71
应收股利		427,655.31	310,694.05
应收申购款		655,779.98	566,388.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	188,426.46	713,278.94
资产总计		426,879,170.36	395,368,291.82
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	1,465,764.36
应付赎回款		5,050,559.00	785,657.42
应付管理人报酬		610,547.32	608,620.02
应付托管费		118,717.52	118,342.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	331,736.04	886,874.57
负债合计		6,111,559.88	3,865,259.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	137,407,318.13	147,461,805.48
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	283,360,292.35	244,041,227.22
净资产合计		420,767,610.48	391,503,032.70
负债和净资产总计		426,879,170.36	395,368,291.82

注：1、本基金基金合同生效日为 2010 年 5 月 25 日。

2、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 3.062 元，基金份额总额为 137,407,318.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		62,024,226.50	-98,812,152.83
1. 利息收入		91,275.76	41,403.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	91,275.76	41,403.24
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）		11,171,802.33	-88,966.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,771,384.00	-3,175,821.42
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	3,400,418.33	3,086,854.84
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	50,415,506.00	-98,823,143.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		309,878.51	-6,297.26
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	35,763.90	64,851.06
<b>减：二、营业总支出</b>		4,352,375.14	4,571,427.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,571,325.35	3,754,635.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	694,424.38	730,068.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	6. 4. 7. 24	86, 625. 41	86, 723. 62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57, 671, 851. 36	-103, 383, 580. 44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57, 671, 851. 36	-103, 383, 580. 44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		57, 671, 851. 36	-103, 383, 580. 44

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	147, 461, 805. 48	-	244, 041, 227. 22	391, 503, 032. 70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	147, 461, 805. 48	-	244, 041, 227. 22	391, 503, 032. 70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10, 054, 487. 35	-	39, 319, 065. 13	29, 264, 577. 78
（一）、综合收益总额	-	-	57, 671, 851. 36	57, 671, 851. 36
（二）、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）	-10, 054, 487. 35	-	-18, 352, 786. 23	-28, 407, 273. 58
其中：1. 基金申购款	11, 675, 348. 12	-	20, 745, 271. 24	32, 420, 619. 36
2. 基金赎回款	-21, 729, 835. 47	-	-39, 098, 057. 47	-60, 827, 892. 94
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	137,407,318.13	-	283,360,292.35	420,767,610.48
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	154,453,316.72	-	343,444,147.40	497,897,464.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	154,453,316.72	-	343,444,147.40	497,897,464.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,244,120.62	-	-113,373,978.65	-118,618,099.27
（一）、综合收益总额	-	-	-103,383,580.44	-103,383,580.44
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,244,120.62	-	-9,990,398.21	-15,234,518.83
其中：1. 基金申购款	23,506,504.66	-	42,203,431.99	65,709,936.65
2. 基金赎回款	-28,750,625.28	-	-52,193,830.20	-80,944,455.48
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-



四、本期期末净资产(基金净值)	149,209,196.10	-	230,070,168.75	379,279,364.85
-----------------	----------------	---	----------------	----------------

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：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
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

工银瑞信全球精选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[2010]178 号文《关于同意工银瑞信全球精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2010 年 5 月 25 日生效，首次设立募集规模为 585,845,814.67 份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司，境外投资顾问为威灵顿管理有限责任合伙制公司。

### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 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

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	31,127,881.91
等于：本金	31,125,224.65
加：应计利息	2,657.26
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	31,127,881.91

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	304,358,564.90	-	393,974,777.41	89,616,212.51
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	304,358,564.90	-	393,974,777.41	89,616,212.51

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

## 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。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	188,426.46
待摊费用	-
合计	188,426.46

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,615.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	74,795.19
预提信息披露费	59,507.37
其他应付款	188,817.94
合计	331,736.04

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	147,461,805.48	147,461,805.48
本期申购	11,675,348.12	11,675,348.12
本期赎回（以“-”号填列）	-21,729,835.47	-21,729,835.47
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	137,407,318.13	137,407,318.13

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。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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	216,357,232.22	27,683,995.00	244,041,227.22
本期利润	7,256,345.36	50,415,506.00	57,671,851.36
本期基金份额交易产生的变动数	-14,999,423.89	-3,353,362.34	-18,352,786.23
其中：基金申购款	17,295,713.41	3,449,557.83	20,745,271.24
基金赎回款	-32,295,137.30	-6,802,920.17	-39,098,057.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	208,614,153.69	74,746,138.66	283,360,292.35

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	91,275.76
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	91,275.76

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,771,384.00
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	7,771,384.00

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	215,164,300.07
减：卖出股票成本总额	207,136,350.00
减：交易费用	256,566.07
买卖股票差价收入	7,771,384.00

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,400,418.33
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	3,400,418.33

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	50,415,506.00
股票投资	50,415,506.00
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	50,415,506.00

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	35,709.29
其他	54.61
合计	35,763.90

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,479.27
其他	843.58
合计	86,625.41

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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（%）
瑞士信贷银行股份 有限公司	7,848,908.29	1.98	29,403,958.69	4.93

##### 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 2023年1月1日至2023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	1,753.34	1.53	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	7,034.24	4.29	-	-

## 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,571,325.35	3,754,635.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,405,626.65	1,425,865.81

注：1、基金管理费按前一估值日的基金资产净值的 1.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一估值日的基金资产净值

2、基金管理人的管理费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	694,424.38	730,068.12

注：1、基金托管费按前一估值日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
纽约梅隆银行股份有限公司	14,071,397.02	54,743.03	4,961,777.28	1,718.61
中国建设银行股份有限公司	17,056,484.89	36,532.73	28,465,037.23	39,684.63

## 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

无。

## 6.4.12 期末(2023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、稽核审计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，对于每一战略环节、业务环节，公司都制定了系统化的风险管理程序，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并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，形成了由三大防线共同筑成的风险管理体系。其中：

(1) 各业务部门是风险管理的第一道防线，将管控好风险作为开展业务的前提和保障，落实各项风险管理措施，承担风险管理的第一责任。第一道防线按照法律法规的规定，制定本业务条线的制度和流程，对经营和业务流程中的风险主动识别、评估和控制，收集和报告风险点，针对薄弱环节及时进行完善。通过对业务和产品相关制度、流程、系统的自我评估、自我检查、自我完善、自我培训，履行业务经营过程中的自我风险控制职能。

(2) 风险管理部、法律合规部和各风险职能部门是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查，负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告。

(3) 稽核审计部是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

同时，公司董事会确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对重大事件、重大决策的风险评估意见和风险管理报告进行审议，审批重大风险的解决方案；公司管理层根据董事会的风险管理战略，制定并确保公司风险管理制度得以全面、有效执行，在董事

会授权范围内批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案，组织各业务部门开展风险管控工作。

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过信用评级团队和中央交易室建立了内部评级体系和交易对手库，对债券发行主体及债券进行内部评级并跟踪进行评级调整，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **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要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 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或未来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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,127,881.91	-	-	-	31,127,881.91
交易性金融资产	-	-	-	393,974,777.41	393,974,777.41

应收清算款	-	-	-	504,649.29	504,649.29
应收股利	-	-	-	427,655.31	427,655.31
应收申购款	-	-	-	655,779.98	655,779.98
其他资产	-	-	-	188,426.46	188,426.46
资产总计	31,127,881.91	-	-	-395,751,288.45	426,879,170.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,050,559.00	5,050,559.00
应付管理人报酬	-	-	-	610,547.32	610,547.32
应付托管费	-	-	-	118,717.52	118,717.52
其他负债	-	-	-	331,736.04	331,736.04
负债总计	-	-	-	6,111,559.88	6,111,559.88
利率敏感度缺口	31,127,881.91	-	-	-389,639,728.57	420,767,610.48
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,837,250.61	-	-	-	21,837,250.61
交易性金融资产	-	-	-	-369,499,425.51	369,499,425.51
应收清算款	-	-	-	2,441,254.71	2,441,254.71
应收股利	-	-	-	310,694.05	310,694.05
应收申购款	-	-	-	566,388.00	566,388.00
其他资产	-	-	-	713,278.94	713,278.94
资产总计	21,837,250.61	-	-	-373,531,041.21	395,368,291.82
负债					
应付清算款	-	-	-	1,465,764.36	1,465,764.36
应付赎回款	-	-	-	785,657.42	785,657.42
应付管理人报酬	-	-	-	608,620.02	608,620.02
应付托管费	-	-	-	118,342.75	118,342.75
其他负债	-	-	-	886,874.57	886,874.57
负债总计	-	-	-	3,865,259.12	3,865,259.12
利率敏感度缺口	21,837,250.61	-	-	-369,665,782.09	391,503,032.70

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2023 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	英镑折合人民币	瑞典克朗折合人民币	瑞士法郎折合人民币	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产								
银行存款	13,877,567.28	185,784.03	23.95	5,288.34	-	-	2,833.14	14,071,496.74
交易性金融资产	291,207,782.53	19,008,280.57	52,558,989.05	26,524,182.91	4,675,542.35	-	-	393,974,777.41
应收股利	227,647.45	200,007.86	-	-	-	-	-	427,655.31
应收清算款	504,649.29	-	-	-	-	-	-	504,649.29
其他资产	188,426.46	-	-	-	-	-	-	188,426.46
资产合计	306,006,073.01	19,394,072.46	52,559,013.00	26,529,471.25	4,675,542.35	-	2,833.14	409,167,005.21
以外币计价的负债								
其他负债	-	185,779.15	-	-	-	-	3,038.79	188,817.94
负债合计	-	185,779.15	-	-	-	-	3,038.79	188,817.94
资产负债表外 汇风险敞口净	306,006,073.01	19,208,293.31	52,559,013.00	26,529,471.25	4,675,542.35	-	-205.65	408,978,187.27

额	3.01							
项目	上年度末 2022 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	英镑折合人民币	瑞典克朗折合人民币	瑞士法郎折合人民币	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产								
银行存款	2,813,545.81	4.73	468,701.06	4,792.11	-	-	9,227.41	3,296,271.12
交易性金融资产	244,665,262.91	15,384,749.55	54,460,336.12	30,611,305.71	-	10,304,236.67	14,073,534.55	369,499,425.51
应收股利	234,158.21	-	-	72,585.46	-	-	3,950.38	310,694.05
应收清算款	2,441,254.71	-	-	-	-	-	-	2,441,254.71
其他资产	-	365,158.66	348,120.28	-	-	-	-	713,278.94
资产合计	250,154,221.64	15,749,912.94	55,277,157.46	30,688,683.28	-	10,304,236.67	14,086,712.34	376,260,924.33
以外币计价的负债								
应付清算款	285,597.63	365,158.66	815,008.07	-	-	-	-	1,465,764.36
其他负债	715,547.67	-	-	-	-	-	-	715,547.67

负债合计	1,001,145.30	365,158.66	815,008.07	-	-	-	-	2,181,312.03
资产负债表外 汇风险敞口净额	249,153.07 6.34	15,384,754.28	54,462,149.39	30,688,683.28	-	10,304,236.67	14,086,712.34	374,079,612.30

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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。		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	20,448,909.36	18,703,980.62
	所有外币相对人民币贬值 5%	-20,448,909.36	-18,703,980.62

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2023年6月30日		上年度末 2022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	393,974,777.41	93.63	369,499,425.51	94.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

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	393,974,777.41	93.63	369,499,425.51	94.38

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。

#### 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。		
	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	19,541,820.82	18,755,210.39
	业绩比较基准减少 5%	-19,541,820.82	-18,755,210.39

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	393,974,777.41	369,499,425.51
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	393,974,777.41	369,499,425.51

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 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	393,974,777.41	92.29
	其中：普通股	381,293,367.05	89.32
	存托凭证	12,681,410.36	2.97
	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	31,127,881.91	7.29
8	其他各项资产	1,776,511.04	0.42
9	合计	426,879,170.36	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。

## 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	287,119,591.81	68.24
英国	30,612,373.63	7.28
法国	29,983,264.87	7.13
中国香港	19,008,280.57	4.52
德国	9,690,846.71	2.30
西班牙	5,292,871.93	1.26
瑞典	4,675,542.35	1.11
比利时	4,484,208.69	1.07
意大利	3,107,796.85	0.74
合计	393,974,777.41	93.63

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（%）
通信服务 Communication Services	43,488,933.14	10.34
非必需消费品 Consumer Discretionary	45,414,637.53	10.79
必需消费品 Consumer Staples	9,295,166.32	2.21
能源 Energy	4,930,350.63	1.17
金融 Financials	84,438,157.70	20.07
保健 Health Care	52,101,152.09	12.38
工业 Industrials	62,448,685.88	14.84
信息技术 Information Technology	88,187,555.80	20.96
材料 Materials	-	-
房地产 Real Estate	-	-

公用事业 Utilities	3,670,138.32	0.87
合计	393,974,777.41	93.63

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	Microsoft Corp	微软公司	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	8,113	19,963,447.61	4.74
2	Alphabet Inc	-	US02079K1079	纳斯达克证券交易所	美国	16,936	14,803,842.72	3.52
3	Amazon.com Inc	亚马逊公司	US0231351067	纳斯达克证券交易所	美国	13,362	12,586,406.56	2.99
4	Meta Platforms Inc	-	US30303M1027	纳斯达克证券交易所	美国	5,783	11,991,976.27	2.85
5	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	US8740391003	纽约证券交易所	美国	11,784	8,593,219.64	2.04
6	Jabil Inc	捷普集团	US4663131039	纽约证券交易所	美国	10,002	7,800,365.70	1.85
7	Visa Inc	维萨公司	US92826C8394	纽约证券交易所	美国	4,431	7,603,520.60	1.81
8	McKesson Corp	-	US58155Q1031	纽约证券交易所	美国	2,433	7,512,268.50	1.79
9	Salesforce Inc	-	US79466L3024	纽约证券交易所	美国	4,720	7,205,186.24	1.71
10	Gartner Inc	-	US3666511072	纽约证券交易所	美国	2,823	7,145,775.20	1.70

				所				
11	Eli Lilly & Co	礼来	US5324571083	纽约证券交易所	美国	2,091	7,085,888.14	1.68
12	Builders FirstSource Inc	-	US12008R1077	纽约证券交易所	美国	7,205	7,080,416.90	1.68
13	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	US90353T1007	纽约证券交易所	美国	22,318	6,961,827.51	1.65
14	UnitedHealth Group Inc	联合健康集团	US91324P1021	纽约证券交易所	美国	1,991	6,914,759.95	1.64
15	Ares Management Corp	阿瑞斯管理有限合伙企业	US03990B1017	纽约证券交易所	美国	9,783	6,810,981.63	1.62
16	Lennar Corp	-	US5260571048	纽约证券交易所	美国	7,381	6,683,237.15	1.59
17	AstraZeneca PLC	阿斯利康公共有限公司	GB0009895292	英国伦敦证券交易所	英国	6,465	6,665,332.45	1.58
18	Analog Devices Inc	亚德诺半导体	US0326541051	纳斯达克证券交易所	美国	4,688	6,599,101.16	1.57
19	NVIDIA Corp	英伟达	US67066G1040	纳斯达克证券交易所	美国	2,139	6,538,191.28	1.55
20	London Stock Exchange Group PLC	伦敦证券交易所	GB00B0SWJX34	英国伦敦证券交易所	英国	8,319	6,363,370.41	1.51
21	Mastercard Inc	万事达股份有限公司	US57636Q1040	纽约证券交易所	美国	2,185	6,209,567.10	1.48
22	Flutter Entertainment PLC	-	IE00BWT6H894	英国伦敦证券交易所	英国	4,222	6,099,209.28	1.45
23	Airbus SE	空中客车有限公司	NL0000235190	法国证券交易所	法国	5,820	6,068,007.40	1.44



24	Edenred	-	FR0010908533	法国证券交易所	法国	12,344	5,964,390.14	1.42
25	Merck & Co Inc	默克	US58933Y1055	纽约证券交易所	美国	7,102	5,921,541.51	1.41
26	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药	US92532F1003	纳斯达克证券交易所	美国	2,274	5,782,398.33	1.37
27	KLA Corp	-	US4824801009	纳斯达克证券交易所	美国	1,646	5,768,666.27	1.37
28	Airbnb Inc	爱彼迎股份有限公司	US0090661010	纳斯达克证券交易所	美国	6,067	5,618,397.09	1.34
29	American Express Co	美国运通	US0258161092	纽约证券交易所	美国	4,333	5,454,095.98	1.30
30	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	17,800	5,441,968.51	1.29
31	Hologic Inc	豪洛捷公司	US4364401012	纳斯达克证券交易所	美国	9,220	5,394,373.30	1.28
32	Industria de Diseno Textil SA	爱特思集团	ES0148396007	西班牙证券交易所	西班牙	18,949	5,292,871.93	1.26
33	FleetCor Technologies Inc	-	US3390411052	纽约证券交易所	美国	2,880	5,225,051.13	1.24
34	Arthur J Gallagher & Co	亚瑟加拉格尔有限公司	US3635761097	纽约证券交易所	美国	3,231	5,126,204.14	1.22
35	Omnicom Group Inc	-	US6819191064	纽约证券交易所	美国	7,432	5,109,759.15	1.21
36	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集团公司	US7181721090	纽约证券交易所	美国	7,237	5,104,853.85	1.21
37	ServiceNow Inc	-	US81762P1021	纽约证券交易所	美国	1,248	5,067,732.17	1.20

				所				
38	Siemens AG	西门子	DE0007236101	德国证券交易所	德国	4,106	4,933,658.06	1.17
39	Schlumberger NV	斯伦贝谢公众有限公司	AN8068571086	纽约证券交易所	美国	13,891	4,930,350.63	1.17
40	Vinci SA	万喜集团	FR0000125486	法国证券交易所	法国	5,874	4,922,211.68	1.17
41	MSCI Inc	-	US55354G1004	纽约证券交易所	美国	1,445	4,899,988.76	1.16
42	Arch Capital Group Ltd	阿契资本集团	BMG0450A1053	纳斯达克证券交易所	美国	8,970	4,851,434.64	1.15
43	Safran SA	赛峰公司	FR0000073272	法国证券交易所	法国	4,220	4,768,805.79	1.13
44	Rheinmetall AG	德国莱茵金属股份有限公司	DE0007030009	德国证券交易所	德国	2,408	4,757,188.65	1.13
45	Flex Ltd	伟创力国际有限公司	SG9999000020	纳斯达克证券交易所	美国	23,779	4,749,168.32	1.13
46	TransUnion	环联有限责任公司	US89400J1079	纽约证券交易所	美国	8,323	4,710,792.32	1.12
47	Volvo AB	沃尔沃集团	SE0000115446	瑞典证券交易所	瑞典	31,410	4,675,542.35	1.11
48	Marriott International Inc/MD	万豪国际	US5719032022	纳斯达克证券交易所	美国	3,437	4,561,954.85	1.08
49	KBC Group NV	-	BE0003565737	布鲁塞尔交易所	比利时	8,906	4,484,208.69	1.07
50	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NL0009538784	纳斯达克证券交易所	美国	2,993	4,426,577.39	1.05
51	ON	安森美	US6821	纳斯达克	美国	6,336	4,330,124.82	1.03

	Semiconduc tor Corp	半导体 公司	891057	克证券 交易所				
52	Reckitt Benckiser Group PLC	利洁时	GB00B2 4CGK77	英国伦 敦证券 交易所	英国	7,752	4,190,312.47	1.00
53	Thales SA	泰雷兹 集团	FR0000 121329	法国证 券交易 所	法国	3,851	4,161,922.50	0.99
54	Publicis Groupe SA	阳狮集 团股份 公司	FR0000 130577	法国证 券交易 所	法国	7,078	4,097,927.36	0.97
55	Axis Bank Ltd	-	US0546 2W1099	英国伦 敦证券 交易所	英国	9,477	4,088,190.72	0.97
56	Everest Re Group Ltd	安富来 集团有 限公司	BMG322 3R1088	纽约证 券交易 所	美国	1,546	3,818,947.73	0.91
57	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太 保	CNE100 0009Q7	香港证 券交易 所	中国 香港	197,400	3,685,476.75	0.88
58	Elevance Health Inc	-	US0367 521038	纽约证 券交易 所	美国	1,146	3,679,061.88	0.87
59	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能 源	KYG306 6L1014	香港证 券交易 所	中国 香港	40,786	3,670,138.32	0.87
60	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平 安	CNE100 0003X6	香港证 券交易 所	中国 香港	77,000	3,538,974.13	0.84
61	AerCap Holdings NV	-	NL0000 687663	纽约证 券交易 所	美国	7,322	3,360,672.18	0.80
62	ExlServic e Holdings Inc	-	US3020 811044	纳斯达 克证券 交易所	美国	2,982	3,254,940.52	0.77
63	Standard Chartered PLC	渣打集 团	GB0004 082847	英国伦 敦证券 交易所	英国	51,338	3,205,958.30	0.76

64	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	US91307C1027	纳斯达克证券交易所	美国	1,972	3,145,528.03	0.75
65	FinecoBank Banca Fineco SpA	-	IT0000072170	意大利证券交易所	意大利	32,037	3,107,796.85	0.74
66	Johnson Controls International plc	江森自控国际有限公司	IE00BY7QL619	纽约证券交易所	美国	5,672	2,792,700.02	0.66
67	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	KYG040111059	香港证券交易所	中国香港	36,200	2,671,722.86	0.63
68	T-Mobile US Inc	-	US8725901040	纳斯达克证券交易所	美国	2,036	2,043,459.13	0.49
69	Ulta Beauty Inc	-	US90384S3031	纳斯达克证券交易所	美国	559	1,900,837.81	0.45

注：上表所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 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	Amazon.com Inc	US0231351067	10,490,143.06	2.68
2	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	US8740391003	8,526,659.09	2.18
3	Meta Platforms Inc	US30303M1027	7,901,745.14	2.02
4	Salesforce Inc	US79466L3024	6,346,973.22	1.62
5	NVIDIA Corp	US67066G1040	6,251,818.95	1.60
6	Jabil Inc	US4663131039	6,136,289.44	1.57
7	Uber Technologies Inc	US90353T1007	6,090,051.08	1.56
8	Lennar Corp	US5260571048	5,593,620.53	1.43
9	Flutter Entertainment PLC	IE00BWT6H894	5,462,308.76	1.40
10	Airbnb Inc	US0090661010	5,338,715.44	1.36
11	MSCI Inc	US55354G1004	4,966,554.60	1.27

12	TransUnion	US89400J1079	4,947,728.50	1.26
13	FleetCor Technologies Inc	US3390411052	4,785,264.14	1.22
14	Alphabet Inc	US02079K1079	4,733,890.57	1.21
15	Microsoft Corp	US5949181045	4,690,683.76	1.20
16	Volvo AB	SE0000115446	4,502,390.36	1.15
17	Reckitt Benckiser Group PLC	GB00B24CGK77	4,413,406.27	1.13
18	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	CNE1000003X6	4,410,186.34	1.13
19	BNP Paribas SA	FR0000131104	4,365,947.28	1.12
20	ServiceNow Inc	US81762P1021	4,304,756.59	1.10

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。

### 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	Humana Inc	US4448591028	5,954,872.59	1.52
2	Charles Schwab Corp/The	US8085131055	5,392,928.88	1.38
3	UBS Group AG	CH0244767585	5,082,129.71	1.30
4	Novartis AG	CH0012005267	5,017,521.84	1.28
5	Accenture PLC	IE00B4BNMY34	4,629,323.71	1.18
6	GoDaddy Inc	US3802371076	4,624,459.75	1.18
7	CNH Industrial NV	NL0010545661	4,607,145.88	1.18
8	Lowe's Cos Inc	US5486611073	4,558,442.89	1.16
9	Morgan Stanley	US6174464486	4,534,822.77	1.16
10	Intuit Inc	US4612021034	4,407,768.99	1.13
11	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	JP3902900004	4,324,867.15	1.10
12	Aon PLC	IE00BLP1HW54	4,275,890.67	1.09
13	TJX Cos Inc/The	US8725401090	4,266,848.50	1.09
14	Raymond James Financial Inc	US7547301090	4,215,791.59	1.08
15	Glencore PLC	JE00B4T3BW64	4,144,347.40	1.06
16	Capgemini SE	FR0000125338	4,135,287.15	1.06
17	CDW Corp/DE	US12514G1085	4,072,308.58	1.04
18	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	US9713781048	4,016,052.52	1.03

19	British American Tobacco PLC	GB0002875804	3,995,182.04	1.02
20	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	US4990491049	3,958,001.71	1.01

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。

### 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	181,196,195.90
卖出收入（成交）总额	215,164,300.07

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	应收清算款	504,649.29
3	应收股利	427,655.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	655,779.98
6	其他应收款	188,426.46
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,776,511.04

#### 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 (%)
45,318	3,032.07	9,832.40	0.01	137,397,485.73	99.99

### 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	73,429.83	0.05

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 5 月 25 日)	585,845,814.67
---------------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	147,461,805.48
本报告期基金总申购份额	11,675,348.12
减：本报告期基金总赎回份额	21,729,835.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	137,407,318.13

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 2023 年 1 月 14 日发布公告，李剑峰先生自 2023 年 1 月 12 日起担任公司首席投资官，张波先生自 2023 年 1 月 12 日起担任公司首席营销官。

#### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。



## 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 (%)	
Goldman Sachs	-	40,688,439.65	10.27	15,486.76	13.49	-
Morgan Stanley	-	38,300,572.57	9.66	6,051.92	5.27	-
Merrill Lynch	-	38,194,582.30	9.64	13,011.10	11.34	-
JP Morgan Chase	-	37,821,262.53	9.54	15,813.11	13.78	-
Barclays Capital	-	32,630,053.44	8.23	8,918.75	7.77	-
Jefferies & Company	-	30,742,137.92	7.76	5,078.85	4.43	-
UBS Securities	-	28,226,014.07	7.12	11,694.61	10.19	-
Cowen & Co	-	21,001,786.42	5.30	4,375.04	3.81	-
Citigroup	-	18,829,142.86	4.75	3,228.17	2.81	-
RBC Capital Markets	-	17,313,063.58	4.37	2,769.93	2.41	-
Sanford C Bernstein & Co	-	13,102,940.94	3.31	1,975.14	1.72	-
Exane	-	7,961,925.34	2.01	2,189.46	1.91	-
Credit Suisse Securities	-	7,848,908.30	1.98	1,753.34	1.53	-
Liquidnet, Inc.	-	6,959,326.58	1.76	1,994.44	1.74	-
ISI Group	-	6,433,744.54	1.62	1,049.52	0.91	-
Bank of Montreal	-	5,237,143.90	1.32	986.24	0.86	-
Instinet	-	4,823,000.75	1.22	961.33	0.84	-

Raymond James & Associates	-	4,317,308.41	1.09	1,103.57	0.96	-
Oppenheimer & Company Inc	-	3,542,585.12	0.89	666.16	0.58	-
Stuart Frankel	-	3,479,971.95	0.88	386.55	0.34	-
Macquarie	-	3,370,349.68	0.85	1,256.12	1.09	-
BTIG LLC	-	2,983,293.59	0.75	2,089.65	1.82	-
R W Baird	-	2,229,415.12	0.56	581.14	0.51	-
Investment Technology Group	-	2,097,371.18	0.53	672.95	0.59	-
Credit Agricole/CLSA	-	1,984,693.74	0.50	2,890.12	2.52	-
Bancroft Capital LLC	-	1,882,069.95	0.47	168.38	0.15	-
BNP-Paribas	-	1,864,824.22	0.47	779.87	0.68	-
Wells Fargo Securities	-	1,420,137.16	0.36	229.02	0.20	-
HSBC Securities	-	1,402,176.11	0.35	1,305.85	1.14	-
Allen & Company	-	1,208,949.59	0.31	652.46	0.57	-
SEB Securities	-	1,183,246.62	0.30	1,064.92	0.93	-
Redburn Partners LL	-	967,150.11	0.24	841.23	0.73	-
Siebert Williams Shank & Co	-	921,541.35	0.23	110.58	0.10	新增
KeyBanc	-	755,779.81	0.19	1,017.73	0.89	-

Capital Markets						
Piper Jaffray Co	-	742,134.76	0.19	615.26	0.54	-
Canaccord Genuity	-	649,339.55	0.16	100.10	0.09	-
Stifel Nicolaus & Co Inc	-	622,668.82	0.16	284.54	0.25	-
Cantor Fitzgerald	-	583,625.02	0.15	216.86	0.19	-
Penserra Securities LLC	-	449,621.70	0.11	22.29	0.02	-
American Veterans Group PBC	-	412,107.69	0.10	61.13	0.05	-
Stephens Inc	-	331,934.90	0.08	201.39	0.18	-
Wall Street Access/GLP	-	330,001.84	0.08	84.30	0.07	-
Loop Capital Markets LLC	-	199,919.93	0.05	5.70	0.00	-
Cabrera Capital	-	181,617.29	0.05	5.62	0.00	-
Mischler Financial Group Inc	-	132,615.07	0.03	16.59	0.01	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets	-	-	-	-	-	-
BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-
BTG Pactual Capital	-	-	-	-	-	-

Berenberg Bank	-	-	-	-	-	-
Blair, W&C	-	-	-	-	-	-
Bradesco	-	-	-	-	-	-
Burke & Quick Partners LLC	-	-	-	-	-	-
CAI/Cheuvreux	-	-	-	-	-	-
CIBC World Markets Inc.	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-
CLSA Americas LLC	-	-	-	-	-	-
Carnegie Intl	-	-	-	-	-	-
CastleOak Securities, L.P.	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-
Cuttone & Company	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Davy Brokers	-	-	-	-	-	-
Desjardin	-	-	-	-	-	-

s Securities Inc						
Deutsche Bank Sec	-	-	-	-	-	-
Dowling & Partners	-	-	-	-	-	-
Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-
Fidelity Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Green Street Advisors	-	-	-	-	-	-
Guggenheim Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Height Securities LLC	-	-	-	-	-	-
ING Financial Mkt	-	-	-	-	-	-
Itau Securities Inc	-	-	-	-	-	-
JMP Securities	-	-	-	-	-	-
Jones Trading	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-
Kim Eng Securities	-	-	-	-	-	-
Kotak Securities	-	-	-	-	-	-
Lazard Capital	-	-	-	-	-	-
Leerink Swann & Co	-	-	-	-	-	-

Liberum Capital	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-
Luminex Trading & Analytics	-	-	-	-	-	-
MKM Partners	-	-	-	-	-	-
Maxim Group LLC	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi UFJ Securities	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities	-	-	-	-	-	-
National Bank Financial Inc	-	-	-	-	-	-
Natixis SA	-	-	-	-	-	-
Needham & Co Inc	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities	-	-	-	-	-	-
Oddo	-	-	-	-	-	-
Olivetree Securities Ltd	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-
Pavilion Global Markets Ltd	-	-	-	-	-	-
Pulse Trading	-	-	-	-	-	-
Renaissance Macro	-	-	-	-	-	-
SMBC	-	-	-	-	-	-

Nikko Capital Mkrts						
Scotiabank	-	-	-	-	-	-
Sidoti & Company LLC	-	-	-	-	-	-
Societe Generale	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-
State Street Global	-	-	-	-	-	-
SunTrust Robinson Humphrey	-	-	-	-	-	-
TD Securities	-	-	-	-	-	-
Telsey Advisory Group LLC	-	-	-	-	-	-
Virtu Americas LLC	-	-	-	-	-	-
Wedbush Securities, Inc	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-
XP Investimentos	-	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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 (%)
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase	-	-	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies & Company	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Cowen & Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C Bernstein & Co	-	-	-	-	-	-	-	-
Exane	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Securities	-	-	-	-	-	-	-	-



Liquidnet, Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ISI Group	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of Montreal	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Raymond James & Associates	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Oppenheimer & Company Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Stuart Frankel	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
R W Baird	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Investment Technology Group	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole/CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bancroft Capital LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP-Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Wells Fargo Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Allen & Company	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SEB Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Redburn Partners LL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Siebert Williams Shank & Co	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KeyBanc Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Piper Jaffray Co	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Canaccord Genuity	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Stifel Nicolaus & Co Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cantor Fitzgerald	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Penserra Securities LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
American Veterans Group PBC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Stephens Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Wall Street Access/GLP	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Loop Capital Markets LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cabrera Capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mischler Financial Group Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG Pactual Capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Berenberg Bank	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Blair, W&C	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bradescob	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Burke & Quick Partners LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAI/Chevroux	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIBC World Markets Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Americas LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Carnegie Intl	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CastleOak	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities, L.P.									
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cuttone & Company	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Davy Brokers	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Desjardins Securities Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Sec	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Dowling & Partners	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Fidelity Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Green Street Advisors	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Guggenheim Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Height Securities LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ING Financial Mkt	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Itau Securities Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JMP Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Jones Trading	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kim Eng	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities									
Kotak Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Lazard Capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Leerink Swann & Co	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Liberum Capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luminex Trading & Analytics	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MKM Partners	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Maxim Group LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi UFJ Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
National Bank Financial Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Natixis SA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Needham & Co Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Oddo	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Olivetree Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Pavilion Global Markets Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Pulse Trading	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Renaissance Macro	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SMBC Nikko Capital Mkrts	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Scotiabank	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Sidoti & Company LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Societe Generale	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-	-	-	-
State Street Global	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SunTrust Robinson Humphrey	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TD Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Telsey Advisory Group LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Virtu Americas LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Wedbush Securities, Inc	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-	-	-	-
XP Investimentos	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 14 日
2	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 14 日
3	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 31 日
4	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 4 日
5	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 26 日
6	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 5 月 31 日
7	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下	中国证监会规定的媒介	2023 年 6 月 30 日

部分基金近期交易日安排的通知		
----------------	--	--

## § 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全球精选股票型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信全球精选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

2023 年 8 月 30 日