

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券
投资基金
2021 年中期报告

2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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 信息披露方式	6
2.5 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	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 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	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 市场中性策略执行情况	59
7.13 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金	
基金简称	工银绝对收益混合发起	
基金主代码	000667	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 26 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	650,152,290.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
下属分级基金的交易代码	000667	000672
报告期末下属分级基金的份额总额	592,183,071.50 份	57,969,219.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	合理地灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选数量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货对冲市场波动风险，追求稳定的长期正投资回报。
投资策略	本基金借助于数量化投研团队在模型计算、组合构建、风险管理的专业能力，相机使用组合 Alpha 对冲策略、个股 Alpha 策略、事件驱动策略等多个量化策略，通过合理匹配收益与风险水平构建投资组合。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）。
风险收益特征	本基金具有低波动率、低下方风险的特点，并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	陆志俊
	联系电话	400-811-9999	95559
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-811-9999	95559
传真		010-66583158	021-62701216

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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	赵桂才	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

2.5 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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
本期已实现收益	6,287,003.83	-2,163,904.07
本期利润	-14,685,314.82	-2,581,134.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0185	-0.0252
本期加权平均净值利润率	-1.40%	-2.03%
本期基金份额净值增长率	-0.52%	-0.95%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	147,092,746.03	9,599,858.54
期末可供分配基金份额利润	0.2484	0.1656
期末基金资产净值	789,685,214.60	72,338,418.84
期末基金份额净值	1.334	1.248
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	33.40%	24.80%

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 2014 年 6 月 26 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

工银绝对收益混合发起 A

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	0.60%	0.26%	0.37%	0.01%	0.23%	0.25%
过去三个月	1.52%	0.19%	1.12%	0.01%	0.40%	0.18%
过去六个月	-0.52%	0.29%	2.23%	0.01%	-2.75%	0.28%

过去一年	4.30%	0.27%	4.49%	0.01%	-0.19%	0.26%
过去三年	20.51%	0.29%	13.50%	0.01%	7.01%	0.28%
自基金合同生效起 至今	33.40%	0.25%	32.93%	0.01%	0.47%	0.24%

工银绝对收益混合发起 B

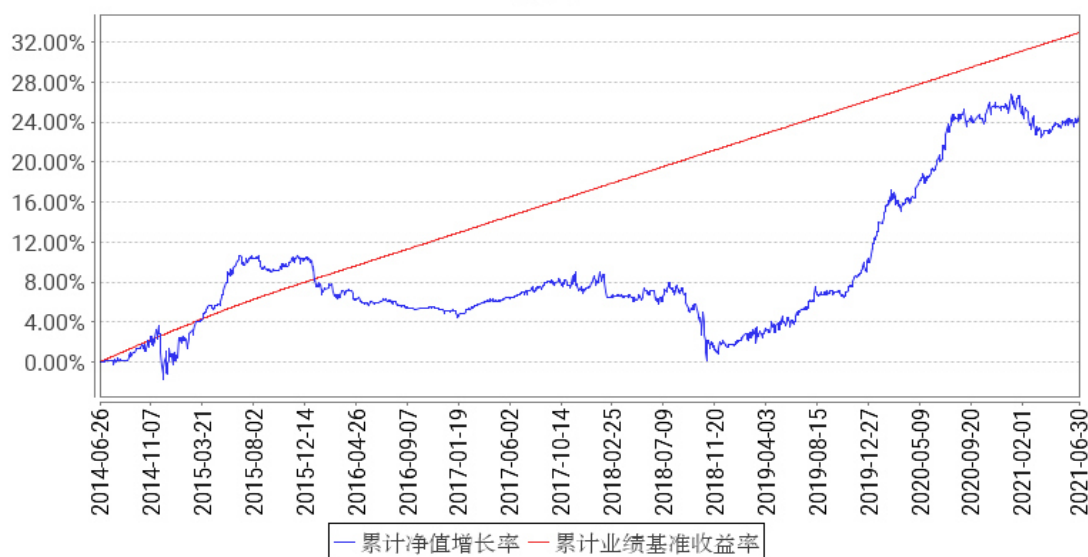
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.48%	0.26%	0.37%	0.01%	0.11%	0.25%
过去三个月	1.30%	0.19%	1.12%	0.01%	0.18%	0.18%
过去六个月	-0.95%	0.28%	2.23%	0.01%	-3.18%	0.27%
过去一年	3.40%	0.27%	4.49%	0.01%	-1.09%	0.26%
过去三年	17.29%	0.28%	13.50%	0.01%	3.79%	0.27%
自基金合同生效起 至今	24.80%	0.26%	32.93%	0.01%	-8.13%	0.25%

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

工银绝对收益混合发起A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



工银绝对收益混合发起B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 2014 年 6 月 26 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证、中央银行票据、中期票据、银行存款、债券回购、资产支持证券、股指期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）；本基金权益类空头寸的价值占本基金权益类多头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间；每个交易日日终，

持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、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 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 2021 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、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、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、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、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 6 个月定期开放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、工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金、工银瑞信战略远见混合型证券投资基金、工银瑞信中证科技龙头 ETF 基金、工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金等逾 180 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		
游凛峰	本基金的基金经理	2014年6月26日	-	25年	<p>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型证券投资基金(QDII)基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银瑞信全球精选股票型证券投资基金(QDII)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；2020 年 12 月 30 日至今，担任工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。</p>

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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有6次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观方面，得益于中国疫情的有效防控，2021年上半年中国经济延续了复苏的趋势，并逐渐趋于平稳增长。受低基数影响，一季度各项数据同比大幅改善，二季度开始逐步回归经济增长的长期趋势。5月份工业增加值增速8.8%，较一季度回落，但仍维持在高位；5月固定资产投资累

积增速 15.4%；5 月社会消费品零售总额同比增长 12.4%。领先指标方面，6 月份中国制造业物流与采购经理人指数（PMI）报 50.9，较年初回落。通胀方面，居民消费价格总水平（CPI）同比增速 1.1%，全国工业生产者出厂价格（PPI）同比增长 8.8%，趋势上尚处于顶部高位。

流动性方面，6 月新增社融相较 5 月进一步上行，环比表现强于往年同期。当月表内新增贷款偏强，对社融形成主要的拉动。6 月新增社融 3.67 万亿，强于去年同期的 3.47 万亿。6 月 M2 增速小幅度反弹但仍处于 2020 年以来相对低位，M1 增速进一步下行。二季度货币市场利率有所上行，6 月份 DR007 均值仍然略高于 2.2%。央行二季度货币政策委员会例会表示要防范外部冲击、促进内外平衡、推动经济在更高水平上均衡。

股市方面，一季度价值风格占优，二季度成长风格占优。从上半年整体来看，成长风格表现更好，具体而言，上证综指上涨 3.4%，沪深 300 指数上涨 0.24%，深证成指收益率为 4.78%。从风格来看，代表大盘股的中证 100 指数和代表中盘指数的中证 200 回报分别为-2.85%和 6.65%，中小 100 和创业板指回报分别为 3.66%和 17.22%。分行业来看，基础化工、钢铁、电力设备及新能源表现排名前三，非银金融、家电、国防军工排名最后三位。

本基金净值波动受股指期货升贴水影响较大，在仓位选择上，本基金根据股指期货基差变化灵活调整。在上半年基金操作中，股指期货在 2 月份转为深度贴水，直到 5 月份和 6 月份贴水基差才有所收敛，整体上对冲成本相对较高。基于基差变化，本基金在一季度适度降低了对冲仓位，并在 5 月份重新加仓，降低了基金的净值波动。受市场风格影响，本基金的 Alpha 组合在一季度贡献了主要的负收益，通过积极的策略调整，本基金在 3 月份控制了组合的进一步回撤，并在二季度收复了大部分负收益。本基金的剩余资金主要用于新股申购以及现金管理，积极参与可转债申购、协议存款、隔夜回购等稳健收益类标的。

在股票配置上，本基金坚持均衡配置，严格控制偏离度风险。在股票选择上，本基金重点配置了各行业中质地较为优秀的龙头股，这些龙头股具有收入及净利润增速稳定且持续、估值合理、盈利能力强、净利润与自由现金流的历史匹配度高等特点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-0.52%，本基金 B 份额净值增长率为-0.95%，业绩比较基准收益率为 2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2021 年下半年 A 股市场整体还将维持震荡格局，以盈利和景气驱动的结构性的机会为主。虽然经济改善最快的阶段大概率已经过去，但在 PPI 高位缓慢回落背景下盈利有支撑，全年 A 股盈利增速整体或还将处于改善通道中，后续需要观察原材料向下游传导的能力和走势进行判断。

态调整，全年看 A 股或是一个利润上行但是估值难扩张的局面。市场展望上，7 月 9 日央行宣布 7 月 15 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，本次降准是否作为货币政策全面宽松的信号仍待进一步观察，目前我们维持短期 A 股震荡的判断。投资线索上，一是聚焦中报盈利高增速标的；二是在中长期成长性方向中选择估值和业绩增长较匹配的新能源光伏及汽车、消费电子、医药等，同时景气持续向好的半导体；三是关注低估值的金融板块。

展望下半年基金操作，本基金将保持相对均衡的风格暴露，密切关注经济增长、流动性和政策面变化，另一方面借助量化工具及时应对市场风险。在组合构建上，我们认为个股 Alpha 仍然是组合未来主要的 Alpha 来源，我们将延续一贯的行业偏离、市值偏离和个股偏离等，力争在风险可控的前提下取得更加稳定的绝对收益。

4.6 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

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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，基金托管人在工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，工银瑞信基金管理有限公司在工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期，由工银瑞信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,326,185.88	51,636,998.58
结算备付金		41,702,305.75	201,915,665.07
存出保证金		62,751,419.05	120,661,161.62
交易性金融资产	6.4.7.2	662,842,866.03	1,207,252,809.17

其中：股票投资		614,921,009.81	1,131,269,820.20
基金投资		-	-
债券投资		47,921,856.22	75,982,988.97
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	89,700,000.00	-
应收证券清算款		6,651,306.60	-
应收利息	6.4.7.5	1,437,035.03	1,203,682.02
应收股利		-	-
应收申购款		96,292.02	925,787.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		866,507,410.36	1,583,596,103.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	16,933,102.10
应付赎回款		2,054,504.17	16,410,887.47
应付管理人报酬		1,069,518.09	1,894,278.71
应付托管费		178,253.04	315,713.11
应付销售服务费		49,576.79	165,470.27
应付交易费用	6.4.7.7	950,098.29	1,884,191.03
应交税费		0.35	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	181,826.19	209,394.63
负债合计		4,483,776.92	37,813,037.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	650,152,290.75	1,164,103,287.71
未分配利润	6.4.7.10	211,871,342.69	381,679,778.48
所有者权益合计		862,023,633.44	1,545,783,066.19
负债和所有者权益总计		866,507,410.36	1,583,596,103.51

注：1、本基金基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额为 650,152,290.75 份，其中工银绝对收益混合发起 A 基金份额总额为 592,183,071.50 份，基金份额净值 1.334 元；工银绝对收益混合发起 B 基金份额总额为 57,969,219.25 份，基金份额净值 1.248 元。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-95,181.12	35,660,588.98
1. 利息收入		4,420,667.70	1,651,470.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,381,235.53	492,110.54
债券利息收入		1,309,743.02	248,485.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,729,689.15	910,874.80
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,083,518.60	31,494,160.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	77,261,138.63	27,572,248.02
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-429,992.88	-16,375.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-66,487,617.00	1,987,681.51
股利收益	6.4.7.16	5,739,989.85	1,950,606.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-21,389,548.78	2,090,251.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	790,181.36	424,706.61
减：二、费用		17,171,267.90	5,378,081.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,812,925.86	2,519,724.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,468,820.99	419,954.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	511,027.06	701,673.55
4. 交易费用	6.4.7.19	6,253,977.10	1,588,611.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.09	48,108.69
7. 其他费用	6.4.7.20	124,516.80	100,009.68

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,266,449.02	30,282,507.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,266,449.02	30,282,507.03

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	1,164,103,287.71	381,679,778.48	1,545,783,066.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,266,449.02	-17,266,449.02
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）	-513,950,996.96	-152,541,986.77	-666,492,983.73
其中：1. 基金申购款	136,139,013.57	43,670,990.79	179,810,004.36
2. 基金赎回款	-650,090,010.53	-196,212,977.56	-846,302,988.09
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）	650,152,290.75	211,871,342.69	862,023,633.44
项目	上年度可比期间 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）	158,699,230.84	20,009,723.49	178,708,954.33

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,282,507.03	30,282,507.03
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）	633,171,345.45	151,991,295.80	785,162,641.25
其中：1. 基金申购款	780,301,882.96	182,668,206.04	962,970,089.00
2. 基金赎回款	-147,130,537.51	-30,676,910.24	-177,807,447.75
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）	791,870,576.29	202,283,526.32	994,154,102.61

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 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：

赵桂才

郝炜

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

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]502 号文《关于核准工银瑞信绝对收益策略混合型发起式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作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2014 年 6 月 26 日正式生效，首次设立募集规模为 1,516,472,591.69 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年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

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

（2）增值税

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。

(3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,326,185.88
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	1,326,185.88
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	603,048,738.42	614,921,009.81	11,872,271.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	47,921,856.22	-187,958.21
	银行间市场	-	-
	合计	47,921,856.22	-187,958.21
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	651,158,552.85	662,842,866.03	11,684,313.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于本报告期末所有的股指期货合约产生的持仓损益金额。因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细请见 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	89,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	89,700,000.00	-

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
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,260.16
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	21,280.52
应收债券利息	1,408,092.45
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	401.90
合计	1,437,035.03

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	950,098.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	950,098.29

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	826.94
应付证券出借违约金	-
预提审计费	112,191.88
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	181,826.19

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银绝对收益混合发起 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	982,544,916.37	982,544,916.37
本期申购	112,423,534.49	112,423,534.49
本期赎回（以“-”号填列）	-502,785,379.36	-502,785,379.36

-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	592,183,071.50	592,183,071.50

工银绝对收益混合发起 B

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	181,558,371.34	181,558,371.34
本期申购	23,715,479.08	23,715,479.08
本期赎回（以“-”号填列）	-147,304,631.17	-147,304,631.17
-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	57,969,219.25	57,969,219.25

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

工银绝对收益混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	230,019,526.36	104,544,389.57	334,563,915.93
本期利润	6,287,003.83	-20,972,318.65	-14,685,314.82
本期基金份额交易产生的变动数	-89,213,784.16	-33,162,673.85	-122,376,458.01
其中：基金申购款	22,139,556.80	15,604,576.25	37,744,133.05
基金赎回款	-111,353,340.96	-48,767,250.10	-160,120,591.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	147,092,746.03	50,409,397.07	197,502,143.10

工银绝对收益混合发起 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,561,141.43	18,554,721.12	47,115,862.55
本期利润	-2,163,904.07	-417,230.13	-2,581,134.20
本期基金份额交易产生的变动数	-16,797,378.82	-13,368,149.94	-30,165,528.76

其中：基金申购款	3,121,397.36	2,805,460.38	5,926,857.74
基金赎回款	-19,918,776.18	-16,173,610.32	-36,092,386.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,599,858.54	4,769,341.05	14,369,199.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	182,961.85
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	1,189,420.30
其他	8,853.38
合计	1,381,235.53

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	77,261,138.63
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	77,261,138.63

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,478,891,418.15
减：卖出股票成本总额	2,401,630,279.52
买卖股票差价收入	77,261,138.63

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-429,992.88
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-429,992.88

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	52,189,294.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	51,619,975.54
减：应收利息总额	999,311.66
买卖债券差价收入	-429,992.88

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-66,487,617.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,739,989.85
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	5,739,989.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-48,893,428.78
股票投资	-48,838,366.60
债券投资	-55,062.18
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-

其他	-
2. 衍生工具	27,503,880.00
权证投资	-
期货投资	27,503,880.00
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	-21,389,548.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	689,280.38
基金转换费收入	100,900.98
合计	790,181.36

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	6,253,977.10
银行间市场交易费用	-
合计	6,253,977.10

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	9,217.55
合计	124,516.80

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

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

无。

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 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	8,812,925.86	2,519,724.55
其中：支付销售机构的客户维护费	747,477.00	423,194.82

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,468,820.99	419,954.06

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银绝对收益混合发起	工银绝对收益混合发起	合计
	A	B	
工银瑞信基金管理有限公司	-	36,215.01	36,215.01
中国工商银行股份有限公司	-	35,209.65	35,209.65
交通银行股份有限公司	-	4,951.60	4,951.60
合计	-	76,376.26	76,376.26
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	324,744.08	324,744.08
中国工商银行股份有限公司	-	46,896.26	46,896.26
交通银行股份有限公司	-	6,513.37	6,513.37
合计	-	378,153.71	378,153.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
基金合同生效日（2014 年 6 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	137,192,193.17	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	137,192,193.17	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.17%	-
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
基金合同生效日（2014 年 6 月 26 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	23,528,627.45	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	23,528,627.45	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.42%	-

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

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

份额单位：份

工银绝对收益混合发起 A

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

工银瑞信投资管理有限 公司	227,664,512.52	38.44	227,664,512.52	23.17
------------------	----------------	-------	----------------	-------

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 2021年1月1日至2021年6月30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
交通银行股份有 限公司	1,326,185.88	182,961.85	148,747,840.48	158,137.82

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(2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
600745	闻泰 科技	2019年 12月 18日	2021 年12 月20 日	非公开 流通受 限	77.93	89.40	12,832	999,997.76	1,147,180.80	-
688276	百克 生物	2021年 6月17 日	2021 年12 月27 日	新股锁 定	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688161	威高 骨科	2021年 6月23 日	2021 年12 月30 日	新股锁 定	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
300957	贝泰 妮	2021年 3月18 日	2021 年9月 27日	新股锁 定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688630	芯碁 微装	2021年 3月25 日	2021 年10	新股锁 定	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-

		日	月 8 日								
688677	海泰新光	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 26 日	新股锁定	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-	
688059	华锐精密	2021 年 2 月 1 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-	
688216	气派科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 23 日	新股锁定	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-	
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-	
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-	
688314	康拓医疗	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 18 日	新股锁定	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-	
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-	
688468	科美诊断	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-	
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-	
688260	昀冢科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-	
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-	
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-	

		日	6日								
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-	
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-	
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-	
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-	
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-	
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-	
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	

		日	月 7 日								
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021 年7月 6日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
300952	恒辉 安防	2021年 3月3 日	2021 年9月 13日	新股锁 定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20		-
301016	雷尔 伟	2021年 6月23 日	2021 年12 月30 日	新股锁 定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
300966	共同 药业	2021年 3月31 日	2021 年10 月11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300945	曼卡 龙	2021年 2月3 日	2021 年8月 10日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300948	冠中 生态	2021年 2月18 日	2021 年8月 25日	新股锁 定	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08		-
300931	通用 电梯	2021年 1月13 日	2021 年7月 21日	新股锁 定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92		-
300961	深水 海纳	2021年 3月23 日	2021 年9月 30日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300950	德固 特	2021年 2月24 日	2021 年9月 3日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47		-
605162	新中 港	2021年 6月29 日	2021 年7月 7日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
300958	建工 修复	2021年 3月18 日	2021 年9月 29日	新股锁 定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300986	志特 新材	2021年 4月21 日	2021 年11 月1日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48		-
300987	川网 传媒	2021年 4月28 日	2021 年11 月11 日	新股锁 定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-
300978	东箭	2021年	2021	新股锁	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-

	科技	4月15日	年10月26日	定						
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰	2021年	2021	新股锁	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-

	生物	4月8日	年10月19日	定							
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-	
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-	
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	7,460	746,000.00	746,000.00	-

113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	2,500	250,000.00	250,000.00	-
--------	------	------------	-----------	-------	--------	--------	-------	------------	------------	---

注：以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项	3.05	2021年7月14日	3.36	250,440	859,418.01	763,842.00	-

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、信用风险管理团队、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，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、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部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等，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，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队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。本基金通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	996,000.00	-
AAA 以下	147,494.74	11,994.75
未评级	-	-
合计	1,143,494.74	11,994.75

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券、同业存单、资产支持证券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

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。

本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。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 2021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	1,326,185.88	-	-	-	-	-	1,326,185.88
结算备付金	41,702,305.75	-	-	-	-	-	41,702,305.75
存出保证金	62,751,419.05	-	-	-	-	-	62,751,419.05
交易性金融资产	-	46,778,361.48	-	-	1,143,494.74	614,921,009.81	662,842,866.03
买入返售金融资产	89,700,000.00	-	-	-	-	-	89,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,651,306.60	6,651,306.60
应收利息	-	-	-	-	-	1,437,035.03	1,437,035.03
应收申购款	-	-	-	-	-	96,292.02	96,292.02
资产总计	195,479,910.68	46,778,361.48	-	-	1,143,494.74	623,105,643.46	866,507,410.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,054,504.17	2,054,504.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,069,518.09	1,069,518.09
应付托管费	-	-	-	-	-	178,253.04	178,253.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	49,576.79	49,576.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	950,098.29	950,098.29
应付税费	-	-	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	-	-	181,826.19	181,826.19
负债总计	-	-	-	-	-	4,483,776.92	4,483,776.92
利率敏感度缺口	195,479,910.68	46,778,361.48	-	-	1,143,494.74	618,621,866.54	862,023,633.44

上年度末 2020 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	51,636,998.58	-	-	-	-	-	51,636,998.58
结算备付金	201,915,665.07	-	-	-	-	-	201,915,665.07
存出保证金	120,661,161.62	-	-	-	-	-	120,661,161.62
交易性金融资产	-	10,877,647.20	65,093,347.02	-	11,994.75	1,131,269,820.20	1,207,252,809.17
应收利息	-	-	-	-	-	1,203,682.02	1,203,682.02
应收申购款	-	-	-	-	-	925,787.05	925,787.05
资产总计	374,213,825.27	10,877,647.20	65,093,347.02	-	11,994.75	1,133,399,289.27	1,583,596,103.51
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	16,933,102.10	16,933,102.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,410,887.47	16,410,887.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,894,278.71	1,894,278.71
应付托管费	-	-	-	-	-	315,713.11	315,713.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	165,470.27	165,470.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,884,191.03	1,884,191.03
其他负债	-	-	-	-	-	209,394.63	209,394.63
负债总计	-	-	-	-	-	37,813,037.32	37,813,037.32
利率敏感度缺口	374,213,825.27	10,877,647.20	65,093,347.02	-	11,994.75	1,095,586,251.95	1,545,783,066.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；
----	--------------------------

	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	利率增加 25 基准点	-36,503.09	-108,184.82
	利率减少 25 基准点	36,802.79	108,546.30

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	614,921,009.81	71.33	1,131,269,820.20	73.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	47,921,856.22	5.56	75,982,988.97	4.92
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	662,842,866.03	76.89	1,207,252,809.17	78.10
----	----------------	-------	------------------	-------

注：1、本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证（如适用）市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证的市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	70,333,594.33	25,924,969.53
	业绩比较基准减少 5%	-70,333,594.33	-25,924,969.53

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	614,921,009.81	70.97
	其中：股票	614,921,009.81	70.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,921,856.22	5.53
	其中：债券	47,921,856.22	5.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	89,700,000.00	10.35
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,028,491.63	4.97
8	其他各项资产	70,936,052.70	8.19
9	合计	866,507,410.36	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	15,180,153.87	1.76
C	制造业	366,027,938.77	42.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,177,733.99	0.25
E	建筑业	19,827,602.69	2.30
F	批发和零售业	15,763,079.76	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	11,383,787.16	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,695,864.22	2.75
J	金融业	115,336,897.23	13.38
K	房地产业	8,735,550.46	1.01
L	租赁和商务服务业	12,390,015.72	1.44
M	科学研究和技术服务业	9,233,642.53	1.07

N	水利、环境和公共设施管理业	3,151,201.33	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	958,746.55	0.11
Q	卫生和社会工作	4,381,337.80	0.51
R	文化、体育和娱乐业	6,666,167.45	0.77
S	综合	-	-
	合计	614,921,009.81	71.33

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。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	10,304	21,192,236.80	2.46
2	601318	中国平安	267,928	17,222,411.84	2.00
3	600036	招商银行	269,763	14,618,456.97	1.70
4	000858	五粮液	46,805	13,942,741.45	1.62
5	000568	泸州老窖	58,563	13,817,354.22	1.60
6	002142	宁波银行	340,376	13,264,452.72	1.54
7	600309	万华化学	107,275	11,673,665.50	1.35
8	601899	紫金矿业	1,137,203	11,019,497.07	1.28
9	000001	平安银行	474,566	10,734,682.92	1.25
10	601012	隆基股份	108,641	9,651,666.44	1.12
11	601166	兴业银行	458,814	9,428,627.70	1.09
12	603259	药明康德	58,967	9,233,642.53	1.07
13	600030	中信证券	357,341	8,912,084.54	1.03
14	601888	中国中免	29,189	8,759,618.90	1.02
15	300408	三环集团	206,300	8,751,246.00	1.02
16	601668	中国建筑	1,834,329	8,529,629.85	0.99
17	600183	生益科技	363,321	8,505,344.61	0.99
18	002810	山东赫达	180,200	8,498,232.00	0.99
19	600570	恒生电子	82,626	7,704,874.50	0.89
20	002594	比亚迪	30,016	7,534,016.00	0.87
21	000776	广发证券	483,500	7,320,190.00	0.85
22	600926	杭州银行	473,192	6,979,582.00	0.81
23	000333	美的集团	97,690	6,972,135.30	0.81
24	300059	东方财富	212,258	6,959,939.82	0.81

25	002179	中航光电	86,066	6,800,935.32	0.79
26	603986	兆易创新	36,082	6,779,807.80	0.79
27	300661	圣邦股份	25,141	6,353,884.93	0.74
28	600588	用友网络	180,089	5,989,760.14	0.69
29	000100	TCL 科技	767,305	5,869,883.25	0.68
30	603068	博通集成	69,504	5,720,179.20	0.66
31	000661	长春高新	14,310	5,537,970.00	0.64
32	600859	王府井	189,200	5,464,096.00	0.63
33	002003	伟星股份	871,895	5,440,624.80	0.63
34	600872	中炬高新	126,900	5,332,338.00	0.62
35	002271	东方雨虹	95,674	5,292,685.68	0.61
36	000002	万 科 A	221,782	5,280,629.42	0.61
37	002371	北方华创	18,955	5,257,737.90	0.61
38	002821	凯莱英	13,548	5,047,984.80	0.59
39	300750	宁德时代	9,300	4,973,640.00	0.58
40	300014	亿纬锂能	46,641	4,847,399.13	0.56
41	600809	山西汾酒	10,749	4,815,552.00	0.56
42	600346	恒力石化	182,620	4,791,948.80	0.56
43	600438	通威股份	105,461	4,563,297.47	0.53
44	600031	三一重工	153,621	4,465,762.47	0.52
45	300413	芒果超媒	64,321	4,412,420.60	0.51
46	300258	精锻科技	329,773	4,409,065.01	0.51
47	000963	华东医药	95,748	4,405,365.48	0.51
48	300347	泰格医药	22,666	4,381,337.80	0.51
49	000725	京东方 A	699,481	4,364,761.44	0.51
50	600745	闻泰科技	44,930	4,257,477.00	0.49
51	002460	赣锋锂业	34,209	4,142,367.81	0.48
52	000739	普洛药业	139,934	4,114,059.60	0.48
53	600039	四川路桥	646,701	4,054,815.27	0.47
54	300274	阳光电源	34,616	3,982,916.96	0.46
55	003022	联泓新科	128,000	3,929,600.00	0.46
56	600176	中国巨石	247,246	3,834,785.46	0.44
57	603538	美诺华	80,000	3,760,000.00	0.44
58	603799	华友钴业	32,745	3,739,479.00	0.43
59	600887	伊利股份	101,425	3,735,482.75	0.43
60	300124	汇川技术	49,945	3,708,915.70	0.43
61	002475	立讯精密	79,802	3,670,892.00	0.43
62	002415	海康威视	56,617	3,651,796.50	0.42
63	601688	华泰证券	230,705	3,645,139.00	0.42
64	002027	分众传媒	385,802	3,630,396.82	0.42
65	603501	韦尔股份	11,236	3,617,992.00	0.42
66	002410	广联达	52,652	3,590,866.40	0.42

67	600585	海螺水泥	86,176	3,537,524.80	0.41
68	000596	古井贡酒	14,600	3,496,700.00	0.41
69	601800	中国交建	539,609	3,496,666.32	0.41
70	600406	国电南瑞	139,470	3,241,282.80	0.38
71	601009	南京银行	307,200	3,231,744.00	0.37
72	300009	安科生物	213,540	3,181,746.00	0.37
73	601021	春秋航空	55,500	3,157,950.00	0.37
74	600729	重庆百货	114,658	3,147,362.10	0.37
75	000546	金圆股份	478,700	3,106,763.00	0.36
76	000786	北新建材	77,700	3,049,725.00	0.35
77	600690	海尔智家	113,673	2,945,267.43	0.34
78	601168	西部矿业	245,660	2,930,723.80	0.34
79	000651	格力电器	54,499	2,839,397.90	0.33
80	601919	中远海控	87,460	2,671,028.40	0.31
81	002372	伟星新材	128,542	2,656,963.14	0.31
82	002812	恩捷股份	11,300	2,645,330.00	0.31
83	000538	云南白药	22,000	2,545,840.00	0.30
84	600329	中新药业	89,302	2,508,493.18	0.29
85	601618	中国中冶	829,166	2,470,914.68	0.29
86	002242	九阳股份	75,100	2,439,999.00	0.28
87	601555	东吴证券	289,300	2,412,762.00	0.28
88	600563	法拉电子	15,056	2,384,268.16	0.28
89	600019	宝钢股份	296,280	2,263,579.20	0.26
90	300357	我武生物	34,898	2,237,659.76	0.26
91	000513	丽珠集团	44,700	2,235,894.00	0.26
92	603027	千禾味业	84,300	2,216,247.00	0.26
93	688012	中微公司	13,293	2,205,574.56	0.26
94	601601	中国太保	74,326	2,153,224.22	0.25
95	000895	双汇发展	65,017	2,067,540.60	0.24
96	600486	扬农化工	18,462	2,063,497.74	0.24
97	688008	澜起科技	28,838	1,798,914.44	0.21
98	688169	石头科技	1,393	1,756,573.00	0.20
99	300957	贝泰妮	6,523	1,755,404.18	0.20
100	600801	华新水泥	97,100	1,706,047.00	0.20
101	002311	海大集团	20,484	1,671,494.40	0.19
102	002050	三花智控	68,803	1,649,895.94	0.19
103	601939	建设银行	237,120	1,576,848.00	0.18
104	600741	华域汽车	59,792	1,570,735.84	0.18
105	000063	中兴通讯	46,000	1,528,580.00	0.18
106	601901	方正证券	162,100	1,517,256.00	0.18
107	603885	吉祥航空	98,600	1,504,636.00	0.17
108	601336	新华保险	32,601	1,496,711.91	0.17

109	601992	金隅集团	547,480	1,472,721.20	0.17
110	600196	复星医药	20,400	1,471,452.00	0.17
111	000878	云南铜业	113,188	1,452,202.04	0.17
112	601111	中国国航	185,500	1,443,190.00	0.17
113	600380	健康元	101,180	1,389,201.40	0.16
114	300003	乐普医疗	42,829	1,375,667.48	0.16
115	300285	国瓷材料	27,888	1,359,540.00	0.16
116	600048	保利地产	106,976	1,287,991.04	0.15
117	601838	成都银行	97,720	1,235,180.80	0.14
118	300251	光线传媒	106,905	1,155,643.05	0.13
119	002409	雅克科技	13,500	1,093,500.00	0.13
120	600132	重庆啤酒	5,400	1,068,930.00	0.12
121	600660	福耀玻璃	19,043	1,063,551.55	0.12
122	600704	物产中大	134,660	1,059,774.20	0.12
123	002241	歌尔股份	24,400	1,042,856.00	0.12
124	601689	拓普集团	27,228	1,019,144.04	0.12
125	002607	中公教育	45,895	958,746.55	0.11
126	002701	奥瑞金	185,100	951,414.00	0.11
127	600600	青岛啤酒	8,000	925,200.00	0.11
128	600705	中航产融	228,460	884,140.20	0.10
129	300026	红日药业	206,800	878,900.00	0.10
130	300601	康泰生物	5,730	853,770.00	0.10
131	603858	步长制药	37,540	844,274.60	0.10
132	002002	鸿达兴业	213,300	838,269.00	0.10
133	000028	国药一致	21,620	818,100.80	0.09
134	601231	环旭电子	46,860	787,716.60	0.09
135	600998	九州通	50,280	772,803.60	0.09
136	601598	中国外运	152,200	768,610.00	0.09
137	002129	中环股份	19,856	766,441.60	0.09
138	600811	东方集团	250,440	763,842.00	0.09
139	600056	中国医药	61,760	750,384.00	0.09
140	300122	智飞生物	4,012	749,160.76	0.09
141	600657	信达地产	214,200	745,416.00	0.09
142	300146	汤臣倍健	22,480	739,592.00	0.09
143	601801	皖新传媒	150,420	709,982.40	0.08
144	000528	柳工	85,020	697,164.00	0.08
145	002254	泰和新材	34,000	689,180.00	0.08
146	600050	中国联通	155,380	671,241.60	0.08
147	600177	雅戈尔	99,460	655,441.40	0.08
148	002236	大华股份	29,450	621,395.00	0.07
149	600765	中航重机	26,712	605,026.80	0.07
150	600073	上海梅林	71,381	584,610.39	0.07

151	000883	湖北能源	124,540	571,638.60	0.07
152	600021	上海电力	82,660	571,180.60	0.07
153	000671	阳光城	108,389	563,622.80	0.07
154	002507	涪陵榨菜	14,800	557,368.00	0.06
155	002230	科大讯飞	8,166	551,858.28	0.06
156	000690	宝新能源	103,040	526,534.40	0.06
157	603605	珀莱雅	2,583	508,101.93	0.06
158	688095	福昕软件	1,981	501,767.49	0.06
159	600900	长江电力	24,000	495,360.00	0.06
160	600582	天地科技	125,600	489,840.00	0.06
161	601155	新城控股	11,620	483,392.00	0.06
162	601669	中国电建	124,620	482,279.40	0.06
163	603906	龙蟠科技	13,700	479,500.00	0.06
164	002938	鹏鼎控股	13,284	476,629.92	0.06
165	601872	招商轮船	102,240	472,348.80	0.05
166	601881	中国银河	43,440	468,283.20	0.05
167	600022	山东钢铁	268,620	462,026.40	0.05
168	300037	新宙邦	4,500	450,450.00	0.05
169	300049	福瑞股份	37,300	440,140.00	0.05
170	600968	海油发展	169,800	439,782.00	0.05
171	600667	太极实业	48,080	437,528.00	0.05
172	688111	金山办公	1,100	434,280.00	0.05
173	300760	迈瑞医疗	900	432,045.00	0.05
174	601216	君正集团	84,820	431,733.80	0.05
175	002429	兆驰股份	70,640	428,784.80	0.05
176	600522	中天科技	42,460	424,600.00	0.05
177	600390	五矿资本	69,860	417,762.80	0.05
178	002430	杭氧股份	12,033	416,221.47	0.05
179	000623	吉林敖东	26,780	414,822.20	0.05
180	601225	陕西煤业	34,960	414,276.00	0.05
181	601880	辽港股份	239,360	409,305.60	0.05
182	000157	中联重科	43,780	404,527.20	0.05
183	000686	东北证券	47,840	404,248.00	0.05
184	600026	中远海能	65,100	401,016.00	0.05
185	002302	西部建设	50,300	397,370.00	0.05
186	000156	华数传媒	50,340	388,121.40	0.05
187	000090	天健集团	70,060	387,431.80	0.04
188	601975	招商南油	178,740	382,503.60	0.04
189	601611	中国核建	52,700	380,494.00	0.04
190	300223	北京君正	3,752	378,651.84	0.04
191	002155	湖南黄金	48,500	375,875.00	0.04
192	000961	中南建设	63,260	374,499.20	0.04

193	600109	国金证券	29,151	369,926.19	0.04
194	002233	塔牌集团	35,520	365,145.60	0.04
195	000581	威孚高科	17,380	362,025.40	0.04
196	600507	方大特钢	52,980	359,204.40	0.04
197	002157	正邦科技	29,800	356,110.00	0.04
198	603444	吉比特	671	355,630.00	0.04
199	000703	恒逸石化	28,583	341,566.85	0.04
200	002508	老板电器	7,100	330,150.00	0.04
201	600060	海信视像	17,500	295,750.00	0.03
202	300595	欧普康视	2,712	280,827.60	0.03
203	000959	首钢股份	49,760	279,651.20	0.03
204	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.03
205	300496	中科创达	1,749	274,697.94	0.03
206	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.03
207	300002	神州泰岳	45,760	221,936.00	0.03
208	600276	恒瑞医药	3,199	217,436.03	0.03
209	002387	维信诺	20,200	210,686.00	0.02
210	002920	德赛西威	1,888	207,831.04	0.02
211	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.02
212	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.02
213	601006	大秦铁路	26,322	173,198.76	0.02
214	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.02
215	601865	福莱特	3,780	149,423.40	0.02
216	603288	海天味业	911	117,473.45	0.01
217	600633	浙数文化	14,160	101,668.80	0.01
218	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
219	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.01
220	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.01
221	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
222	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
223	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
224	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.01
225	601066	中信建投	2,200	69,146.00	0.01
226	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.01
227	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
228	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
229	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
230	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.01
231	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
232	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
233	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
234	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00

235	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
236	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
237	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
238	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
239	002945	华林证券	1,020	14,096.40	0.00
240	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
241	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
242	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
243	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
244	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
245	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
246	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
247	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
248	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
249	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
250	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
251	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
252	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
253	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
254	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
255	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
256	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
257	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
258	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
259	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
260	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
261	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
262	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
263	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
264	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
265	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
266	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
267	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
268	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
269	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
270	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
271	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
272	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
273	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
274	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
275	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
276	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

277	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
278	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
279	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
280	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
281	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
282	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
283	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
284	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
285	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
286	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	41,727,084.42	2.70
2	601012	隆基股份	40,224,390.34	2.60
3	601668	中国建筑	38,210,477.64	2.47
4	600519	贵州茅台	36,809,223.00	2.38
5	000661	长春高新	31,410,781.16	2.03
6	002179	中航光电	30,747,592.38	1.99
7	601899	紫金矿业	29,505,728.48	1.91
8	600585	海螺水泥	29,062,388.00	1.88
9	601166	兴业银行	28,959,157.02	1.87
10	600570	恒生电子	28,674,528.25	1.86
11	002142	宁波银行	28,674,343.90	1.86
12	600036	招商银行	27,704,869.08	1.79
13	000858	五粮液	26,951,098.06	1.74
14	600309	万华化学	26,038,004.00	1.68
15	600926	杭州银行	25,894,281.28	1.68
16	600346	恒力石化	24,827,477.30	1.61
17	601888	中国中免	24,103,049.20	1.56
18	300661	圣邦股份	23,617,775.40	1.53
19	000001	平安银行	23,460,205.76	1.52
20	600887	伊利股份	22,917,428.89	1.48

注：1、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；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	58,027,117.25	3.75

2	601318	中国平安	55,224,449.92	3.57
3	601012	隆基股份	47,254,413.15	3.06
4	600570	恒生电子	44,121,274.66	2.85
5	601668	中国建筑	41,709,628.01	2.70
6	600036	招商银行	40,201,938.52	2.60
7	002179	中航光电	39,214,503.05	2.54
8	601166	兴业银行	36,330,287.79	2.35
9	002142	宁波银行	36,185,111.04	2.34
10	600585	海螺水泥	35,476,020.67	2.30
11	300274	阳光电源	34,378,942.52	2.22
12	600887	伊利股份	33,513,937.82	2.17
13	000661	长春高新	33,134,418.88	2.14
14	000858	五粮液	31,922,079.36	2.07
15	000333	美的集团	30,321,319.49	1.96
16	002430	杭氧股份	29,610,330.14	1.92
17	300661	圣邦股份	29,558,188.31	1.91
18	000001	平安银行	29,234,282.07	1.89
19	002409	雅克科技	29,142,242.39	1.89
20	600183	生益科技	29,065,387.98	1.88

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,934,119,835.73
卖出股票收入（成交）总额	2,478,891,418.15

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	46,778,361.48	5.43
	其中：政策性金融债	46,778,361.48	5.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,143,494.74	0.13
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	47,921,856.22	5.56

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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108604	国开 1805	466,524	46,778,361.48	5.43
2	113050	南银转债	9,960	996,000.00	0.12
3	127036	三花转债	1,126	147,494.74	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2107	IF2107	-331	-515,486,160.00	-10,034,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-10,034,640.00
股指期货投资本期收益（元）					-66,487,617.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					27,503,880.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，对冲股权买入投资，总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 614,921,009.81 元，占基金资产净值的比例为 71.33%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 515,486,160.00 元，占基金资产净值的比例为 59.80%，空头合约市值占股票资产的比例为 83.83%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 10,773,521.63 元，公允价值变动损益为-21,334,486.60 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	62,751,419.05
2	应收证券清算款	6,651,306.60
3	应收股利	-
4	应收利息	1,437,035.03
5	应收申购款	96,292.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,936,052.70

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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

份额级别	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 (%)
工银绝对 收益混合 发起 A	16,598	35,677.98	498,413,396.98	84.17	93,769,674.52	15.83
工银绝对 收益混合 发起 B	10,183	5,692.74	7,737,677.74	13.35	50,231,541.51	86.65
合计	26,781	24,276.62	506,151,074.72	77.85	144,001,216.03	22.15

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	工银绝对收益混合发起 A	797,577.10	0.13
	工银绝对收益混合发起 B	351,093.55	0.61
	合计	1,148,670.65	0.18

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	份额级别	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 究部门负责人持有本开放式 基金	工银绝对收益混合发起 A	-
	工银绝对收益混合发起 B	-
	合计	-
本基金基金经理持有 本开放式基金	工银绝对收益混合发起 A	10~50
	工银绝对收益混合发起 B	10~50
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
基金合同生效日 (2014 年 6 月 26 日) 基金份额总额	516,916,982.06	999,555,609.63
本报告期期初基金份额总额	982,544,916.37	181,558,371.34
本报告期基金总申购份额	112,423,534.49	23,715,479.08
减：本报告期基金总赎回份额	502,785,379.36	147,304,631.17
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	592,183,071.50	57,969,219.25

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 2021 年 1 月 16 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，朱碧艳女士自 2021 年 1 月 15 日起代任工银瑞信基金管理有限公司董事长、总经理。

基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，赵桂才先生自 2021 年 2 月 5 日起担任工银瑞信基金管理有限公司董事长，并代任总经理、法定代表人。

2、基金托管人：

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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	
中泰证券	2	1,332,903,115.82	30.28%	948,093.91	30.86%	-
招商证券	2	1,306,828,928.10	29.69%	929,545.78	30.25%	-
国信证券	2	589,078,909.18	13.38%	360,110.03	11.72%	-
东吴证券	1	555,294,449.11	12.61%	394,979.52	12.86%	-
华西证券	2	428,626,956.31	9.74%	304,883.21	9.92%	-
方正证券	2	182,680,441.31	4.15%	129,941.26	4.23%	-
中信证券	3	6,778,071.99	0.15%	4,821.29	0.16%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，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) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

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	
	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

				比例		的比例
中泰证券	20,736,473.27	33.93%	-	-	-	-
招商证券	18,592,865.50	30.43%	10,172,200,000.00	50.09%	-	-
国信证券	-	-	2,567,500,000.00	12.64%	-	-
东吴证券	1,780,761.60	2.91%	6,710,000,000.00	33.04%	-	-
华西证券	19,999,067.86	32.73%	849,600,000.00	4.18%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	8,600,000.00	0.04%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

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关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月1日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月5日
3	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	2021年1月16日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月29日
5	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	2021年2月6日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证监会规定的媒介	2021年3月8日
7	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金调整申购、赎回业务规则的	中国证监会规定的媒介	2021年6月17日

公告		
----	--	--

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210113-20210630	227,664,512.52	-	-	227,664,512.52	35.02
	2	20210601-20210630	137,192,193.17	-	-	137,192,193.17	21.10
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中，存在基金规模大幅波动的风险，以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

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、中国证监会批准工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式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

2021 年 8 月 28 日