

# 工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	60
8.7 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.....	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
9.4 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.....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
11.8 其他重大事件.....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>68</b>
12.1 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.....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>68</b>
13.1 备查文件目录.....	68
13.2 存放地点.....	69
13.3 查阅方式.....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银中证 500ETF
场内简称	工银 500、工银中证 500ETF
基金主代码	510530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 17 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,979,379.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

邮政编码	100033	100818
法定代表人	赵桂才	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 10 月 17 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	38,853,684.97	162,843,015.18	-47,930,803.65
本期利润	50,160,800.09	110,985,376.16	17,037,292.63
加权平均基金份额本期利润	1.0308	1.4053	0.0196
本期加权平均净值利润率	15.02%	24.32%	1.62%
本期基金份额净值增长率	16.37%	21.56%	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	110,692,048.48	61,299,036.96	-47,930,803.65
期末可供分配基金份额利润	2.2600	1.2143	-0.2294
期末基金资产净值	364,043,146.52	322,409,046.09	1,098,005,573.63

期末基金份额净值	7.4326	6.3869	5.2541
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	43.69%	23.48%	1.58%

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。

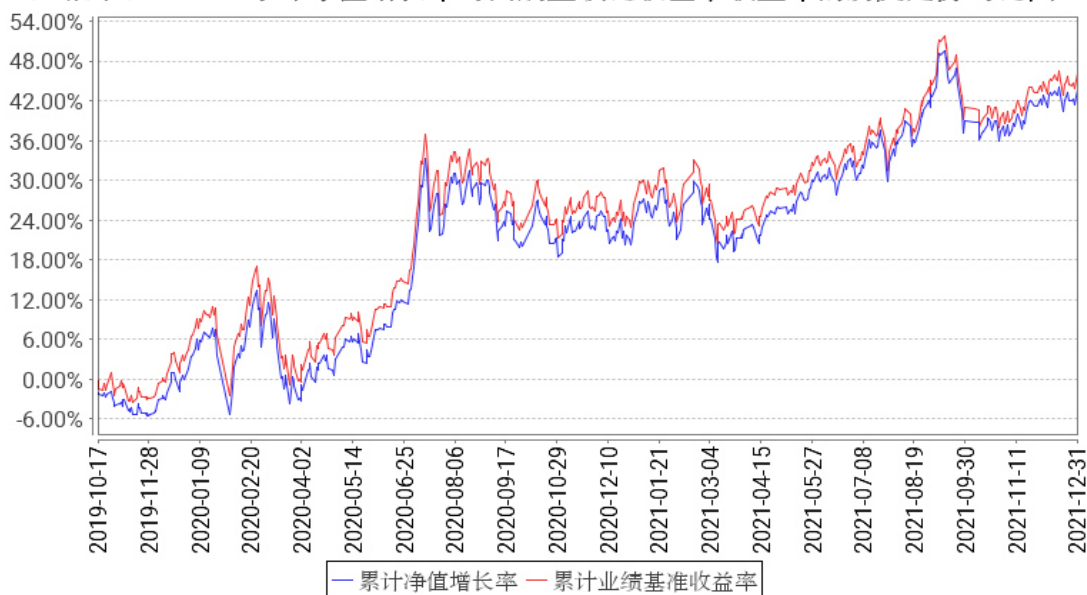
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.38%	0.75%	3.60%	0.76%	-0.22%	-0.01%
过去六个月	8.12%	0.95%	8.10%	0.96%	0.02%	-0.01%
过去一年	16.37%	0.96%	15.58%	0.97%	0.79%	-0.01%
自基金合同生效起至今	43.69%	1.28%	46.07%	1.30%	-2.38%	-0.02%

### 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

工银中证500ETF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

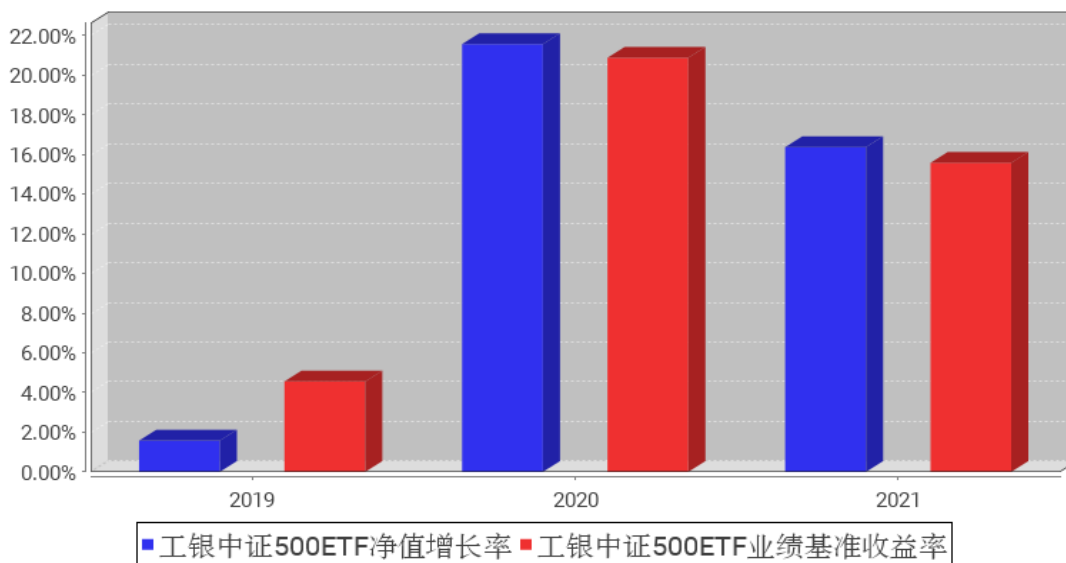


注：1、本基金基金合同于 2019 年 10 月 17 日生效。

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。

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

工银中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。



### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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。

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		
刘伟琳	指数投资中心投资副总监，本基金的基金经理	2019 年 10 月 17 日	-	11 年	博士；2010 年加入工银瑞信，现任指数投资中心投资副总监、基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金(自 2018 年 4 月 17 日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF))基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金（自 2020 年 2 月 18 日起变更为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级证券投资

					<p>基金(自 2020 年 11 月 26 日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金 (LOF))</p> <p>基金经理;2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日,担任工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理;2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日,担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金 (LOF) 基金经理;2018 年 6 月 15 日,担任工银瑞信印度市场证券投资基金(LOF)基金经理;2019 年 5 月 20 日至今,担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2019 年 8 月 21 日至今,担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理;2019 年 10 月 17 日至今,担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2019 年 11 月 1 日至今,担任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基金经理;2019 年 12 月 25 日至今,担任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联接基金基金经理;2020 年 6 月 1 日至今,担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 21 日至今,担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 1 月 22 日至今,担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 6 月 11 日至今,担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 7 月 22 日至今,担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理;2021 年 8 月 5 日至今,担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 11 月 26 日至今,担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
赵栩	指数投资中心副总经理,本基金的基金经理	2019 年 10 月 17 日	-	14 年	<p>2008 年加入工银瑞信,现任指数投资中心副总经理、基金经理,2011 年 10 月 18 日至今,担任上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2012 年 10 月 9 日至今,担任深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2012 年 10</p>

				<p>月 9 日至今，担任工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 27 日，担任工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，担任工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金经理；2017 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2018 年 12 月 7 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 19 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 4 月 24 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金基金经理；2020 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至今，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 9 月 28 日至今，担任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基金经理；2021 年 3 月 5 日至今，担任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联接基金基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信深证物联网 50 交易型开放式指数型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。

3、根据 2022 年 3 月 23 日发布的《关于工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告》，刘伟琳女士自 2022 年 3 月 21 日不再管理本基金。

#### 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类投资组合的公平对待做了明确具体的规定，办法涵盖了公平交易的原则、适用范围、部门职责、具体程序和违规问责等。

在研究和投资决策环节，研究人员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等建立投资备选池，投资人员在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合，并确保公平对待其管理的不同投资组合。

在交易执行环节，交易人员根据公司内部权限管理规定获得权限，并遵循价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施等执行原则，保证交易在不同投资组合间的利益公平。

同时本基金管理人在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于满足条件的指令，系统自动通过公平交易模块执行。

在监控和检查环节，风险管理人员对交易价格公允性等进行监控和分析，监察稽核人员定期对公平交易执行情况进行稽核。发现异常情况的，要求投资人员进行解释说明并核查其真实性、合理性。

本基金管理人通过上述措施全面落实公平交易要求，并持续地完善公平交易制度，确保公平对待各类投资人，保护投资人的利益。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 10 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

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成份股票的停牌；3) 指数成分股调整等。

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 16.37%，业绩比较基准收益率为 15.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2021 年，A 股市场经历了较大的市场波动，市场风格也出现了一定的分化，后续波动和分化仍然会影响 2022 年的市场行情。展望 2022 年，经济增长压力仍在，但经济有望表现出一定的韧性，“稳增长”和“宽信用”的政策有望得到延续，货币政策上流动性得到边际改善的可能性仍在，对于 A 股市场也可能产生更为积极的促进作用。从板块来看，一方面基本面业绩增速相对有优势的行业或主题，未来仍可能保持较好的景气度，良好的成长性有望得到市场的持续关注，另一方面，前期部分板块已经得到一定的估值回调，未来存在估值修复的可能，其配置的性价比得到了一定的提升，但仍需注意包括美联储加息及缩表等海外因素对于 A 股市场的影响，市场的分化和风格的切换大概率仍会延续。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新

法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是严格的事前监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内。五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员和销售人员的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

监察稽核方面，一是定期对基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

###### （1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

###### （2）专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

##### 2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 20759 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“工银中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了工银中证 500ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于工银中证 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>工银中证 500ETF 基金的基金管理人工银瑞信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估工银中证 500ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算工银中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督工银中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导



任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对工银中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张勇   魏佳亮
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,310,260.82	3,139,384.00
结算备付金		40,789.51	508,146.89
存出保证金		18,612.54	106,796.84
交易性金融资产	7.4.7.2	360,793,297.17	319,053,696.42
其中: 股票投资		360,742,486.87	319,053,696.42
基金投资		-	-
债券投资		50,810.30	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		816,102.26	234,892.44
应收利息	7.4.7.5	393.85	652.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		364,979,456.15	323,043,569.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		139,361.31	122,753.43
应付托管费		21,678.42	19,095.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	89,729.81	180,221.30
应交税费		0.02	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	685,540.07	312,453.55
负债合计		936,309.63	634,523.29
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	253,351,098.04	261,110,009.13
未分配利润	7.4.7.10	110,692,048.48	61,299,036.96

所有者权益合计		364,043,146.52	322,409,046.09
负债和所有者权益总计		364,979,456.15	323,043,569.38

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日。

2、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 7.4326 元，基金份额总额为 48,979,379.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		52,751,043.32	116,280,609.44
1. 利息收入		18,311.83	62,501.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,303.70	62,501.68
债券利息收入		8.13	-
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）		40,919,187.03	167,849,576.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	36,395,121.47	163,446,910.90
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,524,065.56	4,402,665.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	11,307,115.12	-51,857,639.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	506,429.34	226,170.21
减：二、费用		2,590,243.23	5,295,233.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,504,834.15	2,067,323.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	234,085.27	321,583.71

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	436,446.19	2,450,798.05
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	414,877.62	455,528.47
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		50,160,800.09	110,985,376.16
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		50,160,800.09	110,985,376.16

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	261,110,009.13	61,299,036.96	322,409,046.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,160,800.09	50,160,800.09
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)	-7,758,911.09	-767,788.57	-8,526,699.66
其中: 1. 基金申购款	82,761,718.34	27,350,273.65	110,111,991.99
2. 基金赎回款	-90,520,629.43	-28,118,062.22	-118,638,691.65
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)	253,351,098.04	110,692,048.48	364,043,146.52

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,080,968,281.00	17,037,292.63	1,098,005,573.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	110,985,376.16	110,985,376.16
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)	-819,858,271.87	-66,723,631.83	-886,581,903.70
其中：1. 基金申购款	840,548,701.79	117,461,302.01	958,010,003.80
2. 基金赎回款	-1,660,406,973.66	-184,184,933.84	-1,844,591,907.50
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)	261,110,009.13	61,299,036.96	322,409,046.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]220 号《关于准予工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,080,938,281.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特

殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0550 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,080,968,281.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 30,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中

以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制

等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人



缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。本基金以使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率为原则进行收益分配。当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时，可进行收益分配。本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的

公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日
	活期存款	3,310,260.82	
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	3,310,260.82		3,139,384.00

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	336,331,724.79	360,742,486.87	24,410,762.08
贵金属投资-金交	-	-	-

所黄金合约				
债券	交易所市场	44,000.00	50,810.30	6,810.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	44,000.00	50,810.30	6,810.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		336,375,724.79	360,793,297.17	24,417,572.38
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	305,943,239.16	319,053,696.42	13,110,457.26	
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	305,943,239.16	319,053,696.42	13,110,457.26	

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	356.22	348.42
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	20.24	251.57
应收债券利息	8.15	-
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	9.24	52.80
合计	393.85	652.79

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	89,729.81	180,221.30
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	89,729.81	180,221.30

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	50,000.00	58,000.00
指数使用费	35,000.00	35,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
IOPV 服务费	100,000.00	99,453.55
应退替代款	379,335.27	-
可退替代款	1,204.80	-
合计	685,540.07	312,453.55

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,479,379.00	261,110,009.13
本期申购	16,000,000.00	82,761,718.34
本期赎回（以“-”号填列）	-17,500,000.00	-90,520,629.43
- 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	48,979,379.00	253,351,098.04
-----	---------------	----------------

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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,768,598.50	-25,469,561.54	61,299,036.96
本期利润	38,853,684.97	11,307,115.12	50,160,800.09
本期基金份额交易产生的变动数	-2,252,556.21	1,484,767.64	-767,788.57
其中：基金申购款	31,349,529.66	-3,999,256.01	27,350,273.65
基金赎回款	-33,602,085.87	5,484,023.65	-28,118,062.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	123,369,727.26	-12,677,678.78	110,692,048.48

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	14,344.72	40,984.96
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	3,305.44	17,914.54
其他	653.54	3,602.18
合计	18,303.70	62,501.68

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	31,521,016.39	107,316,464.00
股票投资收益——赎回差价收入	4,874,105.08	56,130,446.90
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	36,395,121.47	163,446,910.90

**7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	181,953,808.29	1,149,768,130.06
减：卖出股票成本总额	150,432,791.90	1,042,451,666.06
买卖股票差价收入	31,521,016.39	107,316,464.00

**7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	118,638,691.65	1,844,591,907.50
减：现金支付赎回款总额	63,205,369.65	1,011,382,000.50
减：赎回股票成本总额	50,559,216.92	777,079,460.10
赎回差价收入	4,874,105.08	56,130,446.90

**7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

无。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

## 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,524,065.56	4,402,665.67
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	4,524,065.56	4,402,665.67

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	11,307,115.12	-51,857,639.02
股票投资	11,300,304.82	-51,857,639.02
债券投资	6,810.30	-
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	11,307,115.12	-51,857,639.02

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	506,429.34	226,170.21
合计	506,429.34	226,170.21

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	436,446.19	2,450,798.05
银行间市场交易费用	-	-
合计	436,446.19	2,450,798.05

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	58,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
IOPV 服务费	100,000.00	99,453.55
银行费用	4,877.62	22,435.91
指数使用费	140,000.00	155,639.01
合计	414,877.62	455,528.47

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	基金管理人管理的其他基金

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,504,834.15	2,067,323.05
其中：支付销售机构的客户维护费	8,380.15	22,342.28

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.45% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	234,085.27	321,583.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.07% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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（%）
工银瑞信中证	17,593,000.00	35.92	16,490,000.00	32.67

500交易型开放式指数证券投资基金联接基金				
-----------------------	--	--	--	--

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,310,260.82	14,344.72	3,139,384.00	40,984.96

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

7.4.12.1.2 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
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债未上市	100.00	100.00	210	21,000.00	21,000.00	-

注：以上“可流通日”的日期，最终以发行人公告为准。

##### 7.4.12.2 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
002683	广东宏大	2021 年 12 月 20 日	重大事项	30.12	2022 年 1 月 4 日	31.00	23,400	796,477.70	704,808.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

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

无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	50,810.30	-
未评级	-	-
合计	50,810.30	-

注：上述评级均取自第三方评级机构。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 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。

**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

**7.4.13.3.2 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	3,310,260.82	-	-	-	-	-	3,310,260.82
结算备付金	40,789.51	-	-	-	-	-	40,789.51
存出保证金	18,612.54	-	-	-	-	-	18,612.54
交易性金融资产	-	-	-	-	50,810.30	360,742,486.87	360,793,297.17
应收证券清算款	-	-	-	-	-	816,102.26	816,102.26
应收利息	-	-	-	-	-	393.85	393.85
资产总计	3,369,662.87	-	-	-	50,810.30	361,558,982.98	364,979,456.15
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	139,361.31	139,361.31
应付托管费	-	-	-	-	-	21,678.42	21,678.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	89,729.81	89,729.81
应付税费	-	-	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	-	-	685,540.00	685,540.00



						7	
负债总计	-	-	-	-	-	936,309.63	936,309.63
利率敏感度缺口	3,369,662.87	-	-	-	50,810.30	360,622.673.35	364,043,146.52
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	3,139,384.00	-	-	-	-	-	3,139,384.00
结算备付金	508,146.89	-	-	-	-	-	508,146.89
存出保证金	106,796.84	-	-	-	-	-	106,796.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	319,053.696.42	319,053,696.42
应收证券清算款	-	-	-	-	-	234,892.44	234,892.44
应收利息	-	-	-	-	-	652.79	652.79
资产总计	3,754,327.73	-	-	-	-	319,289,241.65	323,043,569.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	122,753.43	122,753.43
应付托管费	-	-	-	-	-	19,095.01	19,095.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	180,221.30	180,221.30
其他负债	-	-	-	-	-	312,453.55	312,453.55
负债总计	-	-	-	-	-	634,523.29	634,523.29
利率敏感度缺口	3,754,327.73	-	-	-	-	318,654,718.36	322,409,046.09

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	

	动	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	利率增加 25 基准点	-733.81	-
	利率减少 25 基准点	746.53	-

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	360,742,486.87	99.09	319,053,696.42	98.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	50,810.30	0.01	-	-
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	360,793,297.17	99.11	319,053,696.42	98.96

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。

##### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	17,987,147.88	15,915,524.23
	业绩比较基准减少 5%	-17,987,147.88	-15,915,524.23

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 360,766,792.68 元，属于第二层次的余额为 26,504.49 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 318,632,363.28 元，第二层次 421,333.14 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 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事项发生的当年年初为确认各层次之间的转换时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	360,742,486.87	98.84
	其中：股票	360,742,486.87	98.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,810.30	0.01
	其中：债券	50,810.30	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,351,050.33	0.92
8	其他各项资产	835,108.65	0.23
9	合计	364,979,456.15	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、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。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,014,992.80	1.10
B	采矿业	13,953,708.05	3.83
C	制造业	217,740,733.59	59.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,515,307.30	3.71
E	建筑业	6,852,173.00	1.88
F	批发和零售业	11,161,545.92	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	8,448,241.12	2.32
H	住宿和餐饮业	2,177,312.00	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,747,328.44	8.45
J	金融业	25,945,409.55	7.13
K	房地产业	9,353,352.37	2.57
L	租赁和商务服务业	4,419,284.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,278,892.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	3,107,069.44	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	751,968.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	4,664,221.00	1.28
S	综合	2,600,730.00	0.71
	合计	360,732,268.58	99.09

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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。

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,504.49	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,218.29	0.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 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

### 8.3.1 期末指数投资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	002340	格林美	245,800	2,544,030.00	0.70
2	000733	振华科技	18,600	2,311,608.00	0.63
3	600522	中天科技	126,000	2,136,960.00	0.59

4	000723	美锦能源	131,500	2,134,245.00	0.59
5	601615	明阳智能	80,600	2,103,660.00	0.58
6	600157	永泰能源	1,142,200	2,078,804.00	0.57
7	600399	抚顺特钢	81,200	2,011,324.00	0.55
8	600885	宏发股份	26,773	1,998,336.72	0.55
9	600884	杉杉股份	59,570	1,952,108.90	0.54
10	000009	中国宝安	132,600	1,913,418.00	0.53
11	002384	东山精密	70,400	1,907,840.00	0.52
12	601117	中国化学	156,900	1,882,800.00	0.52
13	601555	东吴证券	207,720	1,840,399.20	0.51
14	002013	中航机电	99,800	1,814,364.00	0.50
15	300751	迈为股份	2,800	1,798,440.00	0.49
16	002385	大北农	170,100	1,784,349.00	0.49
17	300285	国瓷材料	41,300	1,758,141.00	0.48
18	605358	立昂微	14,200	1,704,142.00	0.47
19	002268	卫士通	30,451	1,703,428.94	0.47
20	300088	长信科技	126,217	1,676,161.76	0.46
21	300037	新宙邦	14,700	1,661,100.00	0.46
22	600765	中航重机	32,400	1,635,876.00	0.45
23	688099	晶晨股份	12,501	1,627,630.20	0.45
24	688005	容百科技	13,900	1,606,562.00	0.44
25	600563	法拉电子	6,900	1,603,560.00	0.44
26	600298	安琪酵母	25,800	1,557,288.00	0.43
27	002028	思源电气	31,414	1,545,882.94	0.42
28	600256	广汇能源	236,200	1,544,748.00	0.42
29	002180	纳思达	32,200	1,537,872.00	0.42
30	600862	中航高科	42,900	1,534,104.00	0.42
31	600141	兴发集团	39,900	1,511,412.00	0.42
32	300363	博腾股份	16,700	1,493,815.00	0.41
33	300253	卫宁健康	88,000	1,474,880.00	0.41
34	600487	亨通光电	97,200	1,469,664.00	0.40
35	002185	华天科技	115,400	1,466,734.00	0.40
36	000988	华工科技	51,800	1,443,148.00	0.40
37	603456	九洲药业	25,500	1,434,630.00	0.39
38	600392	盛和资源	72,100	1,414,602.00	0.39
39	601636	旗滨集团	82,700	1,414,170.00	0.39
40	600754	锦江酒店	23,600	1,382,960.00	0.38
41	300058	蓝色光标	128,100	1,374,513.00	0.38
42	600418	江淮汽车	77,800	1,353,720.00	0.37
43	300699	光威复材	15,900	1,343,232.00	0.37
44	601168	西部矿业	98,000	1,333,780.00	0.37
45	603613	国联股份	12,400	1,333,000.00	0.37

46	300223	北京君正	9,900	1,326,600.00	0.36
47	000630	铜陵有色	378,500	1,317,180.00	0.36
48	603589	口子窖	18,500	1,311,095.00	0.36
49	603267	鸿远电子	7,100	1,274,024.00	0.35
50	600516	方大炭素	117,400	1,270,268.00	0.35
51	002138	顺络电子	33,200	1,267,576.00	0.35
52	002797	第一创业	172,900	1,265,628.00	0.35
53	000998	隆平高科	54,200	1,260,692.00	0.35
54	300136	信维通信	49,700	1,258,404.00	0.35
55	600486	扬农化工	9,500	1,246,400.00	0.34
56	601077	渝农商行	318,100	1,224,685.00	0.34
57	300308	中际旭创	28,800	1,224,000.00	0.34
58	300724	捷佳伟创	10,700	1,223,010.00	0.34
59	600875	东方电气	57,000	1,220,940.00	0.34
60	600038	中直股份	15,100	1,212,530.00	0.33
61	000728	国元证券	156,800	1,207,360.00	0.33
62	601689	拓普集团	22,700	1,203,100.00	0.33
63	002409	雅克科技	14,689	1,192,306.13	0.33
64	300763	锦浪科技	5,100	1,180,905.00	0.32
65	002353	杰瑞股份	29,500	1,180,000.00	0.32
66	300146	汤臣倍健	43,700	1,178,152.00	0.32
67	603893	瑞芯微	8,600	1,177,340.00	0.32
68	600233	圆通速递	70,500	1,175,940.00	0.32
69	002080	中材科技	34,500	1,173,690.00	0.32
70	300474	景嘉微	7,700	1,171,940.00	0.32
71	002212	天融信	61,000	1,169,370.00	0.32
72	002223	鱼跃医疗	30,900	1,168,020.00	0.32
73	000519	中兵红箭	42,900	1,144,143.00	0.31
74	300418	昆仑万维	49,400	1,143,610.00	0.31
75	688065	凯赛生物	6,107	1,125,397.96	0.31
76	002673	西部证券	138,000	1,113,660.00	0.31
77	600733	北汽蓝谷	110,200	1,104,204.00	0.30
78	688208	道通科技	13,900	1,103,660.00	0.30
79	000547	航天发展	65,800	1,098,860.00	0.30
80	002439	启明星辰	38,400	1,095,552.00	0.30
81	000636	风华高科	36,700	1,093,660.00	0.30
82	000932	华菱钢铁	213,400	1,090,474.00	0.30
83	600705	中航产融	274,600	1,090,162.00	0.30
84	600482	中国动力	55,300	1,089,410.00	0.30
85	603077	和邦生物	317,700	1,083,357.00	0.30
86	000039	中集集团	63,040	1,081,766.40	0.30
87	600188	兖矿能源	45,900	1,080,027.00	0.30



88	600699	均胜电子	49,080	1,078,287.60	0.30
89	000807	云铝股份	96,500	1,077,905.00	0.30
90	688536	思瑞浦	1,402	1,076,736.00	0.30
91	688002	睿创微纳	13,686	1,075,309.02	0.30
92	002444	巨星科技	35,200	1,073,952.00	0.30
93	600739	辽宁成大	55,000	1,073,600.00	0.29
94	600529	山东药玻	24,400	1,071,160.00	0.29
95	300296	利亚德	104,400	1,070,100.00	0.29
96	603290	斯达半导	2,800	1,066,800.00	0.29
97	000739	普洛药业	30,285	1,062,700.65	0.29
98	603605	珀莱雅	5,078	1,057,798.18	0.29
99	002465	海格通信	94,700	1,034,124.00	0.28
100	002507	涪陵榨菜	27,300	1,031,940.00	0.28
101	000738	航发控制	33,900	1,026,492.00	0.28
102	600988	赤峰黄金	68,500	1,020,650.00	0.28
103	002030	达安基因	50,552	1,014,073.12	0.28
104	000960	锡业股份	51,500	1,005,795.00	0.28
104	601016	节能风电	154,500	1,005,795.00	0.28
106	600637	东方明珠	105,100	993,195.00	0.27
107	002273	水晶光电	57,100	992,969.00	0.27
108	600521	华海药业	45,800	992,028.00	0.27
109	600549	厦门钨业	43,700	988,931.00	0.27
110	600177	雅戈尔	142,500	981,825.00	0.27
111	688521	芯原股份	12,670	980,151.20	0.27
112	600732	爱旭股份	41,900	978,784.00	0.27
113	601198	东兴证券	82,900	964,127.00	0.26
114	002985	北摩高科	7,980	961,270.80	0.26
115	603127	昭衍新药	8,300	958,069.00	0.26
116	002557	洽洽食品	15,600	957,216.00	0.26
117	002078	太阳纸业	82,700	950,223.00	0.26
118	600704	物产中大	160,300	948,976.00	0.26
119	600201	生物股份	57,974	947,874.90	0.26
120	300383	光环新网	63,300	939,372.00	0.26
121	601128	常熟银行	141,094	932,631.34	0.26
122	600642	申能股份	126,400	931,568.00	0.26
123	002156	通富微电	47,900	930,697.00	0.26
124	603444	吉比特	2,200	928,070.00	0.25
125	002299	圣农发展	38,300	925,711.00	0.25
126	300357	我武生物	16,100	922,530.00	0.25
127	600879	航天电子	111,630	919,831.20	0.25
128	600497	驰宏锌锗	182,920	912,770.80	0.25
129	600369	西南证券	170,900	904,061.00	0.25

130	600027	华电国际	167,800	897,730.00	0.25
131	000830	鲁西化工	58,700	895,762.00	0.25
132	600160	巨化股份	69,300	894,663.00	0.25
133	300618	寒锐钴业	11,100	889,998.00	0.24
134	600372	中航电子	39,700	888,883.00	0.24
135	002739	万达电影	57,300	887,004.00	0.24
136	600039	四川路桥	73,600	886,144.00	0.24
137	002092	中泰化学	92,700	884,358.00	0.24
138	000623	吉林敖东	47,850	883,789.50	0.24
139	002508	老板电器	24,200	871,684.00	0.24
140	000983	山西焦煤	105,380	871,492.60	0.24
141	600316	洪都航空	22,200	867,132.00	0.24
142	600580	卧龙电驱	47,400	866,946.00	0.24
143	300115	长盈精密	43,300	859,072.00	0.24
144	000629	攀钢钒钛	220,800	858,912.00	0.24
145	601997	贵阳银行	131,600	856,716.00	0.24
146	002249	大洋电机	97,300	855,267.00	0.23
147	002131	利欧股份	347,400	854,604.00	0.23
148	603198	迎驾贡酒	12,300	854,235.00	0.23
149	002373	千方科技	56,800	849,160.00	0.23
150	002603	以岭药业	43,020	843,192.00	0.23
151	300017	网宿科技	125,900	842,271.00	0.23
152	002936	郑州银行	264,688	836,414.08	0.23
153	002422	科伦药业	43,800	829,134.00	0.23
154	600170	上海建工	229,300	825,480.00	0.23
155	000825	太钢不锈	116,900	822,976.00	0.23
156	000050	深天马 A	63,200	822,864.00	0.23
157	600118	中国卫星	30,300	822,645.00	0.23
158	000887	中鼎股份	37,600	820,056.00	0.23
159	300070	碧水源	114,000	819,660.00	0.23
160	600859	王府井	30,200	815,400.00	0.22
161	600166	福田汽车	237,000	815,280.00	0.22
162	603218	日月股份	24,700	813,865.00	0.22
163	000400	许继电气	31,100	811,710.00	0.22
164	000750	国海证券	195,780	804,655.80	0.22
165	600867	通化东宝	73,300	803,368.00	0.22
166	600803	新奥股份	43,700	802,332.00	0.22
167	002191	劲嘉股份	52,900	800,377.00	0.22
168	600153	建发股份	88,200	799,974.00	0.22
169	002506	协鑫集成	210,200	798,760.00	0.22
170	002926	华西证券	81,053	798,372.05	0.22
171	300001	特锐德	32,100	798,327.00	0.22

172	002372	伟星新材	32,700	795,264.00	0.22
173	600258	首旅酒店	30,400	794,352.00	0.22
174	300168	万达信息	61,000	794,220.00	0.22
175	000027	深圳能源	97,740	791,694.00	0.22
176	002056	横店东磁	41,800	788,766.00	0.22
177	603707	健友股份	18,770	788,340.00	0.22
178	002266	浙富控股	110,457	786,453.84	0.22
179	600909	华安证券	144,880	783,800.80	0.22
180	600236	桂冠电力	121,400	779,388.00	0.21
181	002002	鸿达兴业	128,200	776,892.00	0.21
182	300251	光线传媒	60,200	773,570.00	0.21
183	600008	首创环保	226,830	773,490.30	0.21
184	000997	新大陆	42,600	771,912.00	0.21
185	002065	东华软件	98,900	771,420.00	0.21
186	600066	宇通客车	70,000	771,400.00	0.21
187	300009	安科生物	58,848	770,320.32	0.21
188	000513	丽珠集团	19,119	768,774.99	0.21
189	000021	深科技	48,200	763,488.00	0.21
190	600271	航天信息	57,000	763,230.00	0.21
191	002152	广电运通	63,800	759,220.00	0.21
192	600536	中国软件	15,200	758,936.00	0.21
193	002408	齐翔腾达	72,040	756,420.00	0.21
194	002203	海亮股份	60,700	754,501.00	0.21
195	600171	上海贝岭	29,400	754,404.00	0.21
196	000975	银泰黄金	85,780	753,148.40	0.21
197	300244	迪安诊断	22,400	751,968.00	0.21
198	002221	东华能源	59,200	745,328.00	0.20
199	300630	普利制药	13,514	743,810.56	0.20
200	600535	天士力	46,700	740,195.00	0.20
201	000656	金科股份	164,400	736,512.00	0.20
202	603156	养元饮品	25,900	735,819.00	0.20
203	600348	华阳股份	61,785	732,152.25	0.20
204	002500	山西证券	110,700	730,620.00	0.20
205	002572	索菲亚	32,900	730,380.00	0.20
206	300212	易华录	20,560	726,796.00	0.20
207	300026	红日药业	92,600	725,058.00	0.20
208	601005	重庆钢铁	344,000	718,960.00	0.20
209	300024	机器人	64,200	717,114.00	0.20
210	603568	伟明环保	19,430	709,777.90	0.19
211	600998	九州通	48,000	706,560.00	0.19
212	002683	广东宏大	23,400	704,808.00	0.19
213	600315	上海家化	17,400	703,134.00	0.19

214	000970	中科三环	43,700	701,385.00	0.19
215	000878	云南铜业	52,400	700,588.00	0.19
216	000012	南玻 A	70,500	700,065.00	0.19
217	002127	南极电商	101,000	696,900.00	0.19
218	601699	潞安环能	61,600	696,696.00	0.19
219	000537	广宇发展	28,700	691,670.00	0.19
220	300315	掌趣科技	141,900	689,634.00	0.19
221	002745	木林森	45,577	689,580.01	0.19
222	000999	华润三九	20,080	687,539.20	0.19
223	600673	东阳光	77,400	687,312.00	0.19
224	002195	二三四五	293,400	686,556.00	0.19
225	600415	小商品城	141,100	684,335.00	0.19
226	603712	七一二	15,803	684,269.90	0.19
227	601872	招商轮船	166,700	683,470.00	0.19
228	002250	联化科技	38,000	682,860.00	0.19
229	600801	华新水泥	34,972	674,959.60	0.19
230	002511	中顺洁柔	40,300	673,413.00	0.18
231	002019	亿帆医药	38,000	669,560.00	0.18
232	300182	捷成股份	105,700	669,081.00	0.18
233	300463	迈克生物	22,800	665,532.00	0.18
234	688006	杭可科技	6,179	664,736.82	0.18
235	002153	石基信息	23,100	663,894.00	0.18
236	600863	内蒙华电	168,000	661,920.00	0.18
237	000690	宝新能源	111,800	661,856.00	0.18
238	600208	新湖中宝	220,400	656,792.00	0.18
239	600970	中材国际	57,000	651,510.00	0.18
240	000060	中金岭南	131,200	644,192.00	0.18
241	002831	裕同科技	19,100	643,479.00	0.18
242	600517	国网英大	88,000	641,520.00	0.18
243	000686	东北证券	72,000	632,160.00	0.17
244	601778	晶科科技	74,100	632,073.00	0.17
245	600380	健康元	48,945	628,453.80	0.17
246	600498	烽火通信	34,900	627,502.00	0.17
247	600839	四川长虹	189,500	627,245.00	0.17
248	002505	鹏都农牧	164,200	627,244.00	0.17
249	601866	中远海发	192,900	626,925.00	0.17
250	300482	万孚生物	15,900	626,142.00	0.17
251	002294	信立泰	22,900	625,628.00	0.17
252	600155	华创阳安	62,700	624,492.00	0.17
253	000930	中粮科技	57,400	623,938.00	0.17
254	603858	步长制药	29,300	617,937.00	0.17
255	002939	长城证券	47,700	617,715.00	0.17

256	688029	南微医学	2,900	616,743.00	0.17
257	688188	柏楚电子	1,600	616,736.00	0.17
258	600390	五矿资本	115,900	616,588.00	0.17
259	000729	燕京啤酒	72,500	614,075.00	0.17
260	600511	国药股份	19,400	611,682.00	0.17
261	600667	太极实业	75,700	611,656.00	0.17
262	002701	奥瑞金	87,200	610,400.00	0.17
263	600500	中化国际	71,000	607,760.00	0.17
263	601992	金隅集团	214,000	607,760.00	0.17
265	000401	冀东水泥	50,800	607,568.00	0.17
266	600718	东软集团	44,600	604,776.00	0.17
267	600728	佳都科技	72,400	603,092.00	0.17
268	600895	张江高科	39,800	599,388.00	0.16
269	002430	杭氧股份	19,900	597,199.00	0.16
270	300376	易事特	59,400	596,970.00	0.16
271	600158	中体产业	39,400	595,728.00	0.16
272	600216	浙江医药	34,800	594,384.00	0.16
273	002004	华邦健康	81,300	588,612.00	0.16
274	002382	蓝帆医疗	36,000	586,440.00	0.16
275	600282	南钢股份	158,400	586,080.00	0.16
276	601179	中国西电	105,500	585,525.00	0.16
277	600764	中国海防	14,400	585,504.00	0.16
278	002128	电投能源	39,400	585,090.00	0.16
279	002532	天山铝业	71,700	584,355.00	0.16
280	603225	新凤鸣	39,300	583,605.00	0.16
281	002966	苏州银行	85,900	581,543.00	0.16
282	000598	兴蓉环境	91,900	580,808.00	0.16
283	002368	太极股份	20,921	576,164.34	0.16
284	002174	游族网络	37,700	574,548.00	0.16
285	300072	三聚环保	72,400	574,132.00	0.16
286	002670	国盛金控	59,500	571,200.00	0.16
287	000540	中天金融	215,900	569,976.00	0.16
288	002595	豪迈科技	20,500	569,080.00	0.16
289	600985	淮北矿业	50,900	569,062.00	0.16
290	002396	星网锐捷	24,100	568,037.00	0.16
291	600528	中铁工业	68,700	564,027.00	0.15
292	600297	广汇汽车	208,400	556,428.00	0.15
293	002048	宁波华翔	25,700	555,891.00	0.15
294	603866	桃李面包	19,540	554,936.00	0.15
295	000581	威孚高科	25,700	553,578.00	0.15
296	600409	三友化工	63,600	553,320.00	0.15
297	603638	艾迪精密	17,300	552,216.00	0.15

298	002925	盈趣科技	16,180	550,605.40	0.15
299	002010	传化智联	63,200	549,840.00	0.15
300	002958	青农商行	142,400	549,664.00	0.15
301	600827	百联股份	41,200	549,196.00	0.15
302	600755	厦门国贸	75,900	547,239.00	0.15
303	600567	山鹰国际	166,300	547,127.00	0.15
304	601717	郑煤机	47,100	545,889.00	0.15
305	600060	海信视像	40,501	544,738.45	0.15
306	300271	华宇软件	42,600	541,020.00	0.15
307	603885	吉祥航空	30,300	537,825.00	0.15
308	000709	河钢股份	218,100	536,526.00	0.15
309	600131	国网信通	24,500	535,325.00	0.15
310	000778	新兴铸管	123,000	532,590.00	0.15
311	600598	北大荒	36,500	531,440.00	0.15
312	002183	怡亚通	80,200	530,924.00	0.15
313	002075	沙钢股份	90,900	529,947.00	0.15
314	000883	湖北能源	100,600	527,144.00	0.14
315	600967	内蒙一机	43,900	524,605.00	0.14
316	600325	华发股份	86,900	523,138.00	0.14
317	603883	老百姓	10,584	522,637.92	0.14
318	002690	美亚光电	13,900	520,694.00	0.14
319	600820	隧道股份	96,700	520,246.00	0.14
320	600782	新钢股份	98,400	519,552.00	0.14
321	600021	上海电力	40,300	516,646.00	0.14
322	600507	方大特钢	66,221	516,523.80	0.14
323	600737	中粮糖业	54,838	515,477.20	0.14
324	601456	国联证券	36,800	514,096.00	0.14
325	600566	济川药业	18,100	512,954.00	0.14
326	000990	诚志股份	32,200	509,404.00	0.14
327	002434	万里扬	34,400	507,056.00	0.14
328	600022	山东钢铁	281,500	503,885.00	0.14
329	600707	彩虹股份	73,800	503,316.00	0.14
330	002281	光迅科技	21,600	503,064.00	0.14
331	601880	辽港股份	289,700	501,181.00	0.14
332	603927	中科软	18,300	500,688.00	0.14
333	000987	越秀金控	57,000	495,900.00	0.14
334	601106	中国一重	141,300	491,724.00	0.14
335	600663	陆家嘴	45,200	490,872.00	0.13
336	600435	北方导航	45,800	489,144.00	0.13
337	002146	荣盛发展	111,900	486,765.00	0.13
338	002124	天邦股份	75,520	486,348.80	0.13
339	601577	长沙银行	62,100	485,001.00	0.13

340	600446	金证股份	33,700	482,584.00	0.13
341	600572	康恩贝	95,600	478,000.00	0.13
342	002390	信邦制药	62,700	465,234.00	0.13
343	601118	海南橡胶	87,800	463,584.00	0.13
344	603650	彤程新材	9,200	462,944.00	0.13
345	688088	虹软科技	10,500	462,630.00	0.13
346	600329	中新药业	14,689	461,381.49	0.13
347	000898	鞍钢股份	123,000	461,250.00	0.13
348	600811	东方集团	152,800	459,928.00	0.13
349	000877	天山股份	30,000	459,300.00	0.13
350	600259	广晟有色	9,300	457,932.00	0.13
351	600597	光明乳业	31,400	455,928.00	0.13
352	603228	景旺电子	13,180	455,105.40	0.13
353	000488	晨鸣纸业	62,800	454,672.00	0.12
354	002440	闰土股份	47,393	454,498.87	0.12
355	002429	兆驰股份	93,200	452,952.00	0.12
356	002233	塔牌集团	42,800	452,824.00	0.12
357	600808	马钢股份	122,700	452,763.00	0.12
358	002155	湖南黄金	43,400	449,624.00	0.12
359	300166	东方国信	41,300	446,040.00	0.12
360	688321	微芯生物	12,700	444,627.00	0.12
361	001914	招商积余	21,810	441,870.60	0.12
362	002416	爱施德	38,300	435,854.00	0.12
363	600037	歌华有线	50,057	434,494.76	0.12
364	600908	无锡银行	76,600	434,322.00	0.12
365	000559	万向钱潮	68,100	433,797.00	0.12
366	601200	上海环境	34,430	433,473.70	0.12
367	600373	中文传媒	34,900	431,364.00	0.12
368	002085	万丰奥威	78,500	430,965.00	0.12
369	002110	三钢闽光	63,150	429,420.00	0.12
370	600906	财达证券	33,400	426,184.00	0.12
371	600398	海澜之家	66,300	424,983.00	0.12
372	600167	联美控股	47,000	423,470.00	0.12
373	600026	中远海能	71,400	422,688.00	0.12
374	002705	新宝股份	16,982	419,455.40	0.12
375	601000	唐山港	152,400	419,100.00	0.12
376	600546	山煤国际	51,000	418,710.00	0.12
377	002081	金螳螂	68,300	415,264.00	0.11
378	600064	南京高科	44,300	413,762.00	0.11
379	601991	大唐发电	127,600	413,424.00	0.11
380	600195	中牧股份	31,414	410,580.98	0.11
381	000528	柳工	53,200	410,172.00	0.11

382	603000	人民网	28,400	409,528.00	0.11
383	601611	中国核建	40,700	405,779.00	0.11
384	000961	中南建设	98,000	405,720.00	0.11
385	601718	际华集团	135,700	404,386.00	0.11
386	000685	中山公用	45,300	400,905.00	0.11
387	002867	周大生	22,500	400,050.00	0.11
388	000158	常山北明	57,800	399,976.00	0.11
389	002038	双鹭药业	37,000	399,970.00	0.11
390	601608	中信重工	88,900	396,494.00	0.11
391	600120	浙江东方	89,534	395,740.28	0.11
392	000090	天健集团	67,400	395,638.00	0.11
393	300133	华策影视	58,400	395,368.00	0.11
394	000959	首钢股份	68,800	394,224.00	0.11
395	002387	维信诺	42,463	394,056.64	0.11
396	601333	广深铁路	173,800	389,312.00	0.11
397	000758	中色股份	70,600	385,476.00	0.11
398	000671	阳光城	127,300	384,446.00	0.11
399	000089	深圳机场	52,500	384,300.00	0.11
400	003022	联泓新科	10,300	375,332.00	0.10
401	600376	首开股份	66,200	374,692.00	0.10
402	600582	天地科技	85,400	374,052.00	0.10
403	000415	渤海租赁	127,000	369,570.00	0.10
404	000718	苏宁环球	77,700	365,967.00	0.10
405	002242	九阳股份	15,700	364,240.00	0.10
406	601598	中国外运	81,300	364,224.00	0.10
407	600062	华润双鹤	26,800	358,316.00	0.10
408	600126	杭钢股份	69,800	358,074.00	0.10
409	601975	招商南油	178,100	357,981.00	0.10
410	000967	盈峰环境	48,800	357,704.00	0.10
411	688289	圣湘生物	6,000	354,000.00	0.10
412	600307	酒钢宏兴	160,700	353,540.00	0.10
413	601098	中南传媒	36,800	352,176.00	0.10
414	000402	金融街	61,580	348,542.80	0.10
415	002458	益生股份	30,700	347,217.00	0.10
416	600556	天下秀	28,000	345,800.00	0.09
417	001965	招商公路	44,500	341,315.00	0.09
418	601958	金铂股份	49,700	340,445.00	0.09
419	600959	江苏有线	103,200	339,528.00	0.09
420	600643	爱建集团	49,800	336,648.00	0.09
421	000563	陕国投 A	101,300	327,199.00	0.09
422	002399	海普瑞	19,100	326,610.00	0.09
423	600056	中国医药	27,600	325,956.00	0.09



424	300257	开山股份	20,500	325,540.00	0.09
425	003035	南网能源	38,700	320,823.00	0.09
426	002563	森马服饰	41,400	320,022.00	0.09
427	601928	凤凰传媒	39,200	317,128.00	0.09
428	600266	城建发展	70,004	315,018.00	0.09
429	603317	天味食品	11,742	314,803.02	0.09
430	601860	紫金银行	93,900	314,565.00	0.09
431	600717	天津港	74,638	312,733.22	0.09
432	600901	江苏租赁	61,400	312,526.00	0.09
433	600968	海油发展	104,200	305,306.00	0.08
434	002815	崇达技术	17,936	302,221.60	0.08
435	300741	华宝股份	6,300	301,455.00	0.08
436	000937	冀中能源	54,400	299,744.00	0.08
437	002244	滨江集团	63,800	297,308.00	0.08
438	600095	湘财股份	29,300	296,516.00	0.08
439	000717	韶钢松山	62,100	294,975.00	0.08
440	600928	西安银行	68,300	293,690.00	0.08
441	002423	中粮资本	35,600	288,360.00	0.08
442	002468	申通快递	31,300	284,517.00	0.08
443	600787	中储股份	45,400	283,296.00	0.08
444	600776	东方通信	24,500	281,995.00	0.08
445	000028	国药一致	7,600	281,048.00	0.08
446	000062	深圳华强	16,200	279,126.00	0.08
447	600006	东风汽车	40,900	278,529.00	0.08
448	002424	贵州百灵	36,400	276,640.00	0.08
449	600729	重庆百货	10,500	273,210.00	0.08
450	600649	城投控股	65,300	268,383.00	0.07
451	600623	华谊集团	29,235	266,038.50	0.07
452	600339	中油工程	85,400	263,032.00	0.07
453	600835	上海机电	16,500	262,680.00	0.07
454	601139	深圳燃气	29,500	260,485.00	0.07
455	002375	亚厦股份	34,400	257,656.00	0.07
456	300869	康泰医学	6,300	255,465.00	0.07
457	600648	外高桥	19,300	255,339.00	0.07
458	600299	安迪苏	20,700	255,024.00	0.07
459	601969	海南矿业	20,800	249,808.00	0.07
460	000031	大悦城	66,000	246,180.00	0.07
461	000156	华数传媒	28,700	242,802.00	0.07
462	600639	浦东金桥	17,469	223,079.13	0.06
463	600871	石化油服	104,200	222,988.00	0.06
464	002653	海思科	10,900	222,360.00	0.06
465	600377	宁沪高速	25,600	220,672.00	0.06

466	000869	张裕 A	6,900	219,834.00	0.06
467	603379	三美股份	9,400	214,132.00	0.06
468	601828	美凯龙	24,200	213,202.00	0.06
469	601228	广州港	63,200	210,456.00	0.06
470	603708	家家悦	12,600	209,664.00	0.06
471	002302	西部建设	26,100	209,583.00	0.06
472	601869	长飞光纤	6,319	206,884.06	0.06
473	601298	青岛港	36,300	206,547.00	0.06
474	000046	泛海控股	107,900	202,852.00	0.06
475	601156	东航物流	9,100	199,108.00	0.05
476	001872	招商港口	11,702	198,348.90	0.05
477	002948	青岛银行	42,400	196,312.00	0.05
478	002945	华林证券	14,000	191,240.00	0.05
479	600823	世茂股份	58,100	190,568.00	0.05
480	000553	安道麦 A	22,525	190,111.00	0.05
481	603786	科博达	2,300	184,690.00	0.05
482	603719	良品铺子	4,200	178,374.00	0.05
483	001203	大中矿业	11,600	174,928.00	0.05
484	603355	莱克电气	5,860	171,815.20	0.05
485	601568	北元集团	20,600	167,478.00	0.05
486	600350	山东高速	32,300	166,668.00	0.05
487	600657	信达地产	44,200	164,866.00	0.05
488	603056	德邦股份	15,800	161,634.00	0.04
489	603515	欧普照明	7,700	159,852.00	0.04
490	600466	蓝光发展	77,371	157,836.84	0.04
491	601665	齐鲁银行	25,800	143,964.00	0.04
492	002946	新乳业	8,900	141,866.00	0.04
493	600917	重庆燃气	16,200	135,918.00	0.04
494	601003	柳钢股份	26,000	135,720.00	0.04
495	600956	新天绿能	7,300	125,633.00	0.03
496	002901	大博医疗	2,280	115,413.60	0.03
497	600903	贵州燃气	11,800	114,224.00	0.03
498	603868	飞科电器	2,500	108,550.00	0.03
499	601187	厦门银行	14,800	102,120.00	0.03
500	603983	丸美股份	2,700	86,049.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资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	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
2	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000799	酒鬼酒	3,285,820.00	1.02
2	600522	中天科技	2,266,076.32	0.70
3	600157	永泰能源	2,215,335.00	0.69
4	000733	振华科技	2,106,120.00	0.65
5	300751	迈为股份	1,996,396.00	0.62
6	600399	抚顺特钢	1,914,177.00	0.59
7	605358	立昂微	1,887,240.00	0.59
8	300037	新宙邦	1,867,487.10	0.58
9	002384	东山精密	1,857,568.00	0.58
10	601555	东吴证券	1,781,800.80	0.55
11	688005	容百科技	1,740,211.09	0.54
12	300253	卫宁健康	1,688,849.00	0.52
13	300363	博腾股份	1,634,059.00	0.51
14	600298	安琪酵母	1,612,723.85	0.50
15	603456	九洲药业	1,540,547.00	0.48
16	601636	旗滨集团	1,504,725.00	0.47
17	601868	中国能建	1,445,808.00	0.45
18	603613	国联股份	1,417,649.34	0.44
19	002439	启明星辰	1,396,888.00	0.43
20	002422	科伦药业	1,388,350.00	0.43

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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	6,515,287.00	2.02
2	002709	天赐材料	4,920,731.24	1.53
3	600089	特变电工	4,695,787.53	1.46
4	002074	国轩高科	4,335,182.30	1.34
5	300207	欣旺达	3,521,553.00	1.09
6	300012	华测检测	3,448,967.00	1.07
7	300316	晶盛机电	3,345,637.56	1.04
8	000799	酒鬼酒	3,269,558.00	1.01
9	300496	中科创达	2,907,816.00	0.90
10	600460	士兰微	2,904,512.71	0.90
11	300595	欧普康视	2,840,433.30	0.88

12	600426	华鲁恒升	2,682,562.10	0.83
13	600132	重庆啤酒	2,235,836.00	0.69
14	002625	光启技术	2,161,891.66	0.67
15	603486	科沃斯	2,115,595.00	0.66
16	603882	金域医学	2,103,230.00	0.65
17	002648	卫星化学	2,004,503.80	0.62
18	601233	桐昆股份	1,947,004.00	0.60
19	600143	金发科技	1,944,830.56	0.60
20	600219	南山铝业	1,928,907.00	0.60

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

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	180,864,477.45
卖出股票收入（成交）总额	181,953,808.29

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	50,810.30	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,810.30	0.01

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113633	科沃转债	230	29,810.30	0.01
2	113634	珀莱转债	210	21,000.00	0.01

**8.7 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。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

**8.12.2 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。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,612.54
2	应收证券清算款	816,102.26
3	应收股利	-
4	应收利息	393.85
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	835, 108. 65

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001234	泰慕士	5, 504. 49	0. 00	新股未上市

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
458	106, 941. 88	47, 514, 910. 00	97. 01	1, 464, 469. 00	2. 99

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国银行股份有限公司-工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	17, 593, 000. 00	35. 92

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	国开金融有限责任公司	28,282,724.00	57.74
2	申万宏源证券有限公司	509,708.00	1.04
3	广发证券股份有限公司	450,851.00	0.92
4	中信证券股份有限公司	407,010.00	0.83
5	华泰证券股份有限公司	269,674.00	0.55
6	虞朋荣	173,900.00	0.36
7	王琦	91,800.00	0.19
8	梁华明	60,063.00	0.12
9	陈世友	53,566.00	0.11
10	陈惠芳	50,194.00	0.10
11	中国银行股份有限公司-工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	17,593,000.00	35.92

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## 9.4 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 17 日）基金份额总额	1,080,968,281.00
本报告期期初基金份额总额	50,479,379.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	17,500,000.00
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	48,979,379.00
-------------	---------------

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；  
2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

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》，王海璐女士自 2021 年 1 月 15 日起不再担任工银瑞信基金管理有限公司总经理，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。

基金管理人于 2021 年 7 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告》，赵桂才先生自 2021 年 7 月 6 日起担任工银瑞信基金管理有限公司法定代表人。

基金管理人于 2021 年 7 月 24 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告》，高翀先生自 2021 年 7 月 22 日起担任工银瑞信基金管理有限公司总经理。

#### 2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。



### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	119,544,163.68	33.40%	73,078.68	32.60%	-
海通证券	1	72,194,605.94	20.17%	44,131.45	19.69%	-
招商证券	1	57,884,472.91	16.17%	35,384.59	15.78%	-
长江证券	2	53,041,254.88	14.82%	37,728.63	16.83%	-
银河证券	2	52,005,779.33	14.53%	31,790.17	14.18%	-
兴业证券	1	2,607,600.00	0.73%	1,594.23	0.71%	-
广发证券	1	351,130.24	0.10%	249.71	0.11%	-
国泰君安	1	213,062.24	0.06%	130.24	0.06%	-
华泰证券	4	106,434.57	0.03%	75.75	0.03%	-
中信建投	2	21,736.56	0.01%	15.45	0.01%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	2021 年 1 月 16 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	2021 年 2 月 6 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 3 月 31 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 5 月 27 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 7 月 8 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 7 月 24 日

7	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 11 月 17 日
8	工银瑞信基金管理有限公司住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 12 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20210101-20211231	16,490,000.00	5,213,000.00	4,110,000.00	17,593,000.00	35.92
	2	20210101-20211231	28,282,724.00	-	-	28,282,724.00	57.74
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》的规定,对《基金合同》和《托管协议》进行了修订,并在投资范围中增加存托凭证,修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 3 月 31 日起生效,详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件;
- 2、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- 4、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数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。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 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](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日