

工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

§ 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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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
§ 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.....	16
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.....	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
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.....	22
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	63
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.....	63
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.....	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12 投资组合报告附注.....	63
§ 9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
9.3 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.....	65
§ 10 开放式基金份额变动.....	65
§ 11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 13 备查文件目录.....	71
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点.....	71
13.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	工银新价值灵活配置混合	
基金主代码	001648	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 4 月 27 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	135,393,081.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银新价值灵活配置混合 A	工银新价值灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001648	012237
报告期末下属分级基金的份额总额	62,097,756.03 份	73,295,325.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过识别宏观经济周期与资本市场轮动的行为模式，深入研究不同周期与市场背景下各类型资产的价值与回报，通过“自上而下”的大类资产配置与“自下而上”的个券选择，在风险可控的范围内追求组合收益的最大化。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，增加固定收益类资产配置比例，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。
业绩比较基准	55%×沪深 300 指数收益率+45%×一年期人民币定期存款基准利率（税后）。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	工银瑞信基金管理有限公司		中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	秦一楠
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-811-9999		95599
传真	010-66583158		010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9	
邮政编码	100033		100031
法定代表人	赵桂才		谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	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、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
	工银新价值灵活 配置混合 A	工银新价值灵活配 置混合 C	工银新价值灵活配 置混合 A	工银新价值灵活配 置混合 A
本期已实现 收益	24,913,480.66	6,274,996.55	28,830,954.49	9,748,856.45
本期利润	16,530,301.21	4,066,426.06	40,462,094.20	16,565,148.01
加权平均基 金份额本期 利润	0.1700	0.1075	0.3254	0.1837
本期加权平 均净值利润 率	12.52%	7.59%	30.46%	20.48%
本期基金份	12.82%	12.08%	35.05%	24.41%

额净值增长率				
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	28,090,905.59	32,747,429.17	31,101,053.97	-6,706,640.52
期末可供分配基金份额利润	0.4524	0.4468	0.2103	-0.0467
期末基金资产净值	90,188,661.62	106,042,754.22	190,296,203.52	136,783,149.03
期末基金份额净值	1.452	1.447	1.287	0.953
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	45.20%	12.08%	28.70%	-4.70%

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

工银新价值灵活配置混合 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
过去三个月	3.64%	0.57%	1.05%	0.44%	2.59%	0.13%
过去六个月	4.61%	0.79%	-2.54%	0.56%	7.15%	0.23%
过去一年	12.82%	0.90%	-1.83%	0.64%	14.65%	0.26%

过去三年	89.56%	0.82%	36.04%	0.71%	53.52%	0.11%
自基金合同生效起至今	45.20%	0.88%	28.60%	0.68%	16.60%	0.20%

工银新价值灵活配置混合 C

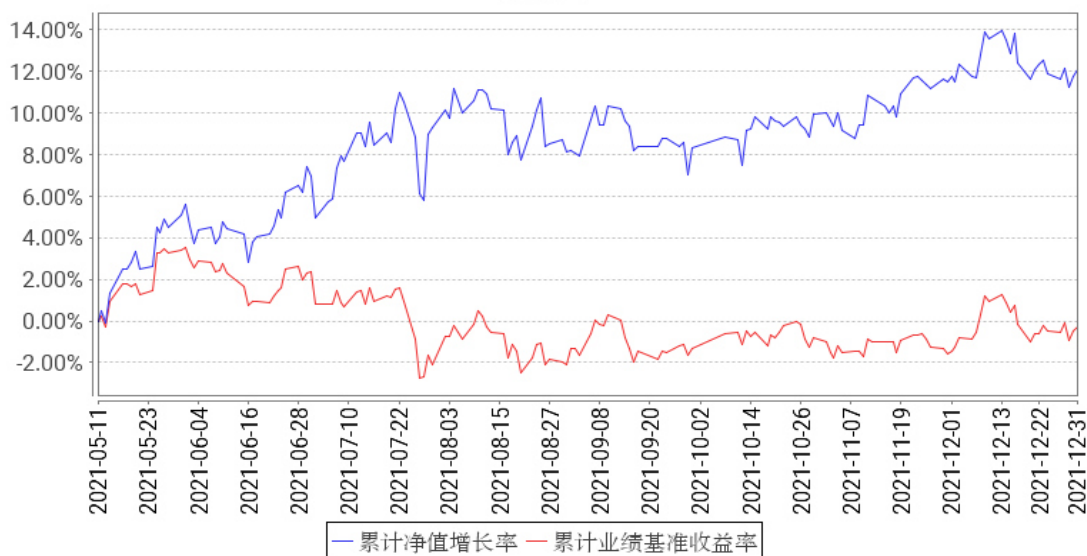
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.51%	0.57%	1.05%	0.44%	2.46%	0.13%
过去六个月	4.33%	0.79%	-2.54%	0.56%	6.87%	0.23%
自基金合同生效起至今	12.08%	0.78%	-0.28%	0.56%	12.36%	0.22%

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

工银新价值灵活配置混合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



工银新价值灵活配置混合C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



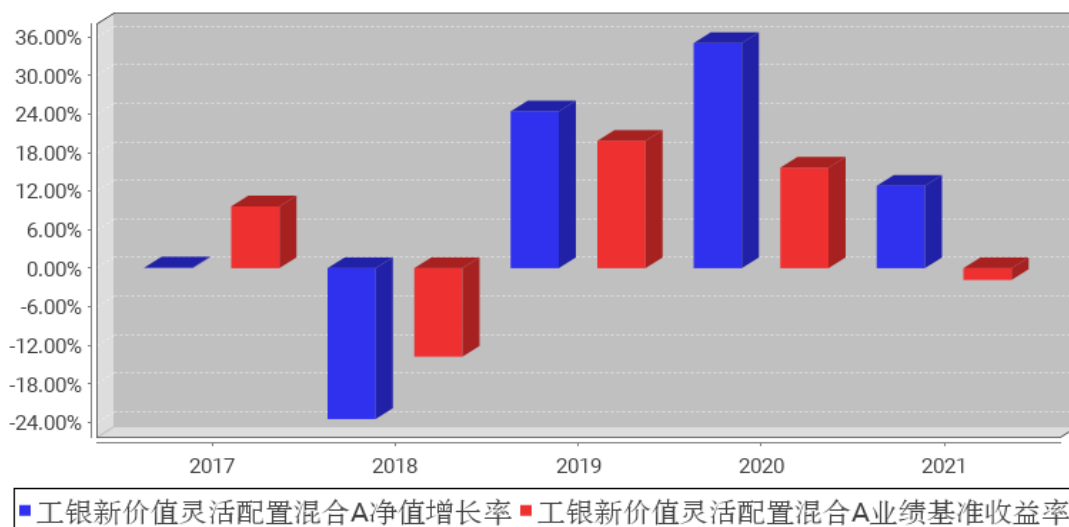
注：1、本基金基金合同于 2017 年 4 月 27 日生效。

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。

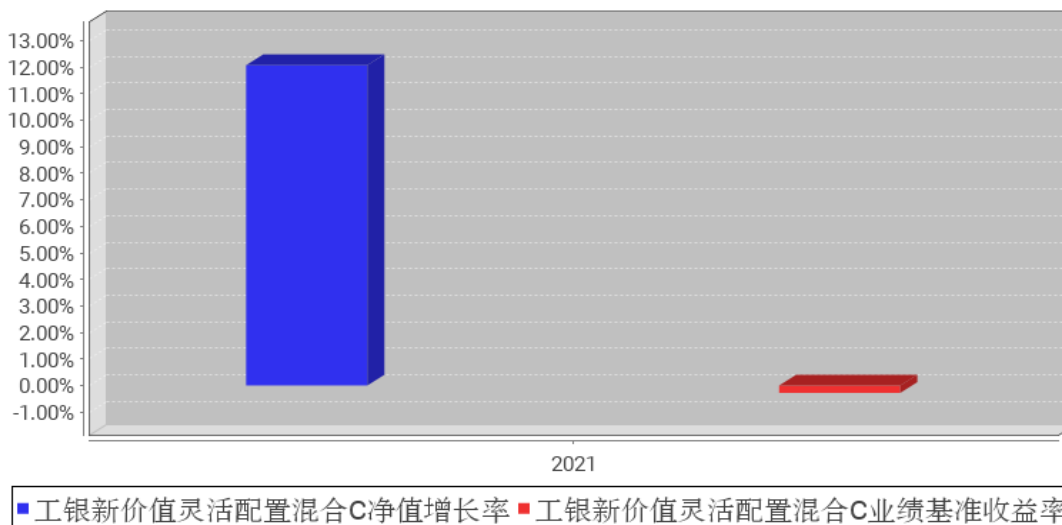
3、本基金自 2021 年 5 月 11 日增加 C 类份额类别。

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

工银新价值灵活配置混合A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



工银新价值灵活配置混合C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		
游 凜 峰	本基金的 基金经理	2017 年 4 月 27 日	-	26 年	斯坦福大学统计学专业博士；先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金基金经理,Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理, Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金基金经理；2009 年加入工银瑞信，现任指数投资中心基金经理；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策略混合型基金经理；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证券投资基金基金经理；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证券投资基金（QDII）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。

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 2 月 19 日发布的《关于工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告》，张乐涛先生自 2022 年 2 月 18 日起管理本基金。

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

回顾 2021 年，海外疫情持续反复，delta、ormicron 病毒扩散对全球经济带来持续冲击。受通胀高企影响美联储货币政策边际收紧，权益市场、大宗商品分化明显。国内股票市场呈现明显结构性特征，全年新发基金规模保持正增长，IPO 规模维持高位。A 股市场在上半年经历了“茅指数”趋势行情及周期行情，板块之间快速轮动，下半年成长风格占优，国防军工、汽车和元宇宙等板块涨幅居前。全年行业分化较大，多数行业估值收缩，盈利增长贡献主要涨幅，涨幅最多的是电力设备及新能源、基础化工和有色金属，涨幅分别为 50.4%、48.1% 和 46.4%，消费者服务、非银金融和家电是排名最后 3 位的行业，跌幅分别是 -24.4%、-20.4% 和 -18.6%。

在基金操作上，本基金一直坚持基本面量化的选股逻辑，从多个维度定义并寻找优质价值型公司。考察维度包括增速、估值、盈利能力、净利润与自由现金流的匹配度等。选股流程通过寻找最具有长期投资价值的细分行业中的优质龙头或有潜力成为龙头的企业。在股票配置上，本基金重点配置了以盈利能力为核心，兼顾合理估值和盈利改善的指数增强组合；重点关注上市公司自由现金流和估值。

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 12.82%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 -1.83%，本基金 C 份额净值增长率为 12.08%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为 -0.28%。

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 2022 年全球经济延续疫后复苏趋势，但增速较 2021 年有所放缓，稳增长政策托底经济增长态度明确，稳增长发力的节奏、力度和效果仍面临一定挑战。预计全年 GDP 增速 5.3% 左右，名义 GDP 增速预计在 7.5% 左右，在经济增速恢复到这一增长水平之前，宏观政策整体都将偏向稳增长。考虑到需求侧政策的发力和结构性政策的纠偏，财政存款调整后的社融增速由 10 月的 9.8% 逐渐回升至 12 月的 10.3%，经济增长将逐渐企稳。稳健的货币政策将维持偏宽松取向，货币政策以我为主，我们认为 2022 年货币政策有可能进一步降准降息，“稳增长”仍需宏观流动性的支

持，流动性宽松可期。

我们认为 2022 年 A 股市场的主线是盈利见顶回落，流动性边际改善，未来一年 A 股总量上难有较大机会，机会更多来自于盈利驱动和估值修复的方向。预计 2022 年 A 股盈利增速将由 2021 年的 20%-30% 回落至 -5%-7%，基于金融板块净利润 5% 的同比增速，预计全 A 净利润增速为 3.8%。在 A 股盈利下行周期中，股票市场整体往往面临估值收缩的压力，指数难有较大表现，以结构性机会为主。2022 年我们从两个维度考察 A 股每个细分行业的投资性价比——长期投资维度（3 年以上）及中短期维度（1-2 年内）的投资机会。长期投资维度包括：新能源、特殊化工及材料、消费升级、半导体及电子元器件、医药和云计算等。短期投资包括疫情反转、周期反转和政策扶持/托底等。在个股选择上，我们将坚持一贯的投资逻辑，偏好于选择各个细分赛道中具有优势龙头地位、高增速及高行业壁垒的远期估值有性价比的公司。

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，利用系统和人工相结合的方式，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 risk 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一

工银瑞信基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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 20764 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	工银瑞信新价值灵活配置混合型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新价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“工银新价值灵活配置混合基金”)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,公允反映了工银新价值灵活配置混合基金 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，我们独立于工银新价值灵活配置混合基金，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>工银新价值灵活配置混合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新价值灵活配置混合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新价值灵活配置混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督工银新价值灵活配置混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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，就可能对工银新价</p>

	<p>值灵活配置混合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新价值灵活配置混合基金不能持续经营。</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：工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,552,768.27	64,946,026.29
结算备付金		6,094,989.32	22,778,586.62
存出保证金		3,227,531.16	2,137,260.64
交易性金融资产	7.4.7.2	179,337,077.93	124,386,334.62
其中：股票投资		169,764,539.85	117,166,946.46
基金投资		-	-
债券投资		9,572,538.08	7,219,388.16
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	6,500,000.00	-
应收证券清算款		709,378.37	-
应收利息	7.4.7.5	81,586.74	129,472.83
应收股利		-	-
应收申购款		21,559.59	7,513.47
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		197,524,891.38	214,385,194.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		706,159.73	23,546,088.08
应付赎回款		17,774.25	124,583.53
应付管理人报酬		245,391.67	145,889.07
应付托管费		40,898.59	24,314.82
应付销售服务费		50,299.81	-
应付交易费用	7.4.7.7	63,609.76	78,815.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	169,341.73	169,300.00
负债合计		1,293,475.54	24,088,990.95
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	135,393,081.08	147,897,070.45
未分配利润	7.4.7.10	60,838,334.76	42,399,133.07
所有者权益合计		196,231,415.84	190,296,203.52
负债和所有者权益总计		197,524,891.38	214,385,194.47

注：1、本基金基金合同生效日为2017年4月27日。

2、报告截止日2021年12月31日，基金份额总额为135,393,081.08份，其中工银新价值灵活配置混合A基金份额总额为62,097,756.03份，基金份额净值1.452元；工银新价值灵活配置混合C基金份额总额为73,295,325.05份，基金份额净值1.447元。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金

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		24,487,545.63	43,572,092.19
1. 利息收入		529,834.91	958,638.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	83,319.59	196,820.41

债券利息收入		240,382.73	176,645.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		206,132.59	585,172.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,359,428.36	30,904,568.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	33,448,816.06	32,578,595.63
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-108,384.76	-36,988.62
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	-1,023,372.00	-3,496,539.61
股利收益	7.4.7.16	2,042,369.06	1,859,500.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,591,749.94	11,631,139.71
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	190,032.30	77,745.66
减：二、费用		3,890,818.36	3,109,997.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,507,558.35	1,998,855.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	417,926.31	333,142.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	205,347.35	-
4. 交易费用	7.4.7.19	545,118.22	559,755.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	5,282.35
7. 其他费用	7.4.7.20	214,868.13	212,961.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,596,727.27	40,462,094.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,596,727.27	40,462,094.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金

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)	147,897,070.45	42,399,133.07	190,296,203.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,596,727.27	20,596,727.27
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)	-12,503,989.37	-2,157,525.58	-14,661,514.95
其中：1. 基金申购款	146,545,146.06	56,870,417.90	203,415,563.96
2. 基金赎回款	-159,049,135.43	-59,027,943.48	-218,077,078.91
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)	135,393,081.08	60,838,334.76	196,231,415.84
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)	143,489,789.55	-6,706,640.52	136,783,149.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	40,462,094.20	40,462,094.20
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)	4,407,280.90	8,643,679.39	13,050,960.29
其中：1. 基金申购款	105,846,168.93	23,138,856.14	128,985,025.07
2. 基金赎回款	-101,438,888.03	-14,495,176.75	-115,934,064.78

回款			
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）	147,897,070.45	42,399,133.07	190,296,203.52

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

工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]1386号《关于准予工银瑞信新价值灵活配置混合型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《工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 237,974,059.43 元,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(2017)第 396 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 238,050,824.68 份基金份额,其中认购资金利息折合 76,765.25 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》、《工银瑞信新价值灵活配置混合型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

本基金同一类的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期

末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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	1,552,768.27		64,946,026.29
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	1,552,768.27		64,946,026.29	

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	161,329,457.37	169,764,539.85	8,435,082.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,552,673.23	9,572,538.08
	银行间市场	-	-
	合计	9,552,673.23	9,572,538.08
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	170,882,130.60	179,337,077.93	8,454,947.33
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	97,728,369.62	117,166,946.46	19,438,576.84

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	7,274,727.73	7,219,388.16	-55,339.57
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,274,727.73	7,219,388.16	-55,339.57
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	105,003,097.35	124,386,334.62	19,383,237.27	

7.4.7.3 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 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,500,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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	384.39	3,400.14
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	3,063.10	2,543.44

应收债券利息	80,774.99	123,510.11
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-2,645.42	-
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	9.68	19.14
合计	81,586.74	129,472.83

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	63,609.76	78,815.45
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	63,609.76	78,815.45

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	41.73	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	169,341.73	169,300.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银新价值灵活配置混合 A

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	147,897,070.45	147,897,070.45
本期申购	32,496,721.04	32,496,721.04
本期赎回（以“-”号填列）	-118,296,035.46	-118,296,035.46
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	62,097,756.03	62,097,756.03
-----	---------------	---------------

工银新价值灵活配置混合 C

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	-	-
本期申购	114,048,425.02	114,048,425.02
本期赎回 (以“-”号填列)	-40,753,099.97	-40,753,099.97
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	73,295,325.05	73,295,325.05

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

工银新价值灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,101,053.97	11,298,079.10	42,399,133.07
本期利润	24,913,480.66	-8,383,179.45	16,530,301.21
本期基金份额 交易产生的变 动数	-26,934,904.94	-3,903,623.75	-30,838,528.69
其中：基金申 购款	9,305,462.91	1,094,681.06	10,400,143.97
基金赎 回款	-36,240,367.85	-4,998,304.81	-41,238,672.66
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	29,079,629.69	-988,724.10	28,090,905.59

工银新价值灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,274,996.55	-2,208,570.49	4,066,426.06
本期基金份额 交易产生的变 动数	27,621,868.49	1,059,134.62	28,681,003.11
其中：基金申 购款	43,923,923.50	2,546,350.43	46,470,273.93
基金赎 回款	-16,302,055.01	-1,487,215.81	-17,789,270.82

本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,896,865.04	-1,149,435.87	32,747,429.17

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	37,117.76	60,687.21
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	45,607.93	135,484.95
其他	593.90	648.25
合计	83,319.59	196,820.41

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	33,448,816.06	32,578,595.63
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	33,448,816.06	32,578,595.63

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	191,760,777.94	210,020,132.41
减：卖出股票成本总额	158,311,961.88	177,441,536.78
买卖股票差价收入	33,448,816.06	32,578,595.63

7.4.7.12.3 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

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
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	-108,384.76	-36,988.62
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	-108,384.76	-36,988.62

7.4.7.13.2 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
卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成交总额	20,876,199.04	10,496,407.80
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	20,434,393.43	10,206,238.17
减：应收利息总额	550,190.37	327,158.25
买卖债券差价收入	-108,384.76	-36,988.62

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	-1,023,372.00	-3,496,539.61

7.4.7.16 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
股票投资产生的股利收益	2,042,369.06	1,859,500.90
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	2,042,369.06	1,859,500.90

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-10,928,289.94	11,953,639.71
股票投资	-11,003,494.36	12,006,938.98
债券投资	75,204.42	-53,299.27
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-

其他	-	-
2. 衍生工具	336,540.00	-322,500.00
权证投资	-	-
期货投资	336,540.00	-322,500.00
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	-10,591,749.94	11,631,139.71

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	189,574.31	77,489.47
基金转换费收入	457.99	256.19
合计	190,032.30	77,745.66

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	545,118.22	559,755.22
银行间市场交易费用	-	-
合计	545,118.22	559,755.22

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	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	17,668.13	15,761.92
合计	214,868.13	212,961.92

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金销售机构、基金管理人股东
瑞士信贷银行股份有限公司	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

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	2,507,558.35	1,998,855.88
其中：支付销售机构的客户维护费	293,250.30	193,216.20

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

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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	417,926.31	333,142.62

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

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银新价值灵活配置混合 A	工银新价值灵活配置混合 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	15.47	15.47
合计	-	15.47	15.47
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	工银新价值灵活配置混合 A	工银新价值灵活配置混合 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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固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

无。

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
中国农业银行股份有限公司	1,552,768.27	37,117.76	64,946,026.29	60,687.21

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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
688385	复旦微电	2021年7月27日	2022年2月7日	新股锁定	6.23	48.58	5,322	33,156.06	258,542.76	-
688733	壹石通	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	15.49	75.36	1,969	30,499.81	148,383.84	-
688248	南网科技	2021年12月14日	2022年6月22日	新股锁定	12.24	18.90	5,419	66,328.56	102,419.10	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	1,642	68,931.16	68,931.16	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	6,190	65,118.80	65,118.80	-
688091	上海谊众	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	38.10	42.81	1,284	48,920.40	54,968.04	-
688722	同益中	2021年10月8日	2022年4月19日	新股锁定	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	263	3,718.82	23,635.81	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	3.55	18.24	1,254	4,451.70	22,872.96	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	344	4,093.60	15,634.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定	19.11	67.93	195	3,726.45	13,246.35	-
301017	漱玉	2021年	2022年	新股锁	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-

	平民	6月23日	1月5日	定							
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19		-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70		-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股锁定	11.88	21.16	538	6,391.44	11,384.08		-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	202	4,452.08	11,368.56		-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定	60.66	96.75	117	7,097.22	11,319.75		-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	19.23	541	6,692.17	10,403.43		-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	86	10,051.68	9,982.88		-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股锁定	4.13	12.96	737	3,043.81	9,551.52		-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95		-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股锁定	26.91	43.36	219	5,893.29	9,495.84		-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91		-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	44.86	200	5,234.00	8,972.00		-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股锁定	13.00	20.48	423	5,499.00	8,663.04		-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	96	6,709.44	8,517.12		-

301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	651	4,530.96	8,144.01	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股锁定	22.70	49.02	154	3,495.80	7,549.08	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	141	5,510.28	7,350.33	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	543	2,883.33	7,330.50	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	232	5,048.32	6,774.40	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股锁定	27.12	30.58	208	5,640.96	6,360.64	-

		日	日								
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股锁 定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-	
301100	风光股份	2021年 12月10 日	2022年 6月17 日	新股锁 定	27.81	31.14	199	5,534.19	6,196.86	-	
301041	金百泽	2021年 8月2 日	2022年 2月11 日	新股锁 定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-	
301072	中捷精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股锁 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 4月20 日	新股锁 定	12.95	17.44	345	4,467.75	6,016.80	-	
301083	百胜智能	2021年 10月13 日	2022年 4月21 日	新股锁 定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
301049	超越科技	2021年 8月17 日	2022年 2月24 日	新股锁 定	19.34	32.92	176	3,403.84	5,793.92	-	
301189	奥尼电子	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定	66.18	56.62	102	6,750.36	5,775.24	-	
300854	中兰环保	2021年 9月8 日	2022年 3月16 日	新股锁 定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-	
301063	海锅股份	2021年 9月9 日	2022年 3月24 日	新股锁 定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-	
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	-	
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定	27.85	27.46	196	5,458.60	5,382.16	-	
301038	深水规院	2021年 7月22 日	2022年 2月7 日	新股锁 定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-	
301036	双乐股份	2021年 7月21 日	2022年 2月16 日	新股锁 定	23.38	29.93	177	4,138.26	5,297.61	-	
301059	金三	2021年	2022年	新股锁	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-	

	江	9月3日	3月14日	定						
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	98	4,311.02	4,975.46	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	162	4,978.26	4,720.68	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	79.60	78.53	58	4,616.80	4,554.74	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股锁定	57.27	53.71	76	4,352.52	4,081.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	49.85	74	4,297.92	3,688.90	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

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
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	2,330	233,000.00	233,000.00	-

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

无。

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

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

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	545,364.80	-
AAA 以下	24,697.28	3,518.46
未评级	-	-
合计	570,062.08	3,518.46

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。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	1,552,768.27	-	-	-	-	-	1,552,768.27
结算备付金	6,094,989.32	-	-	-	-	-	6,094,989.32
存出保证金	3,227,531.16	-	-	-	-	-	3,227,531.16
交易性金融资产	-	-	9,002,476.00	-	570,062.08	169,764,539.85	179,337,077.93
买入返售金融资产	6,500,000.00	-	-	-	-	-	6,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	709,378.37	709,378.37
应收利息	-	-	-	-	-	81,586.74	81,586.74
应收申购款	-	-	-	-	-	21,559.59	21,559.59
资产总计	17,375,288.75	-	9,002,476.00	-	570,062.08	170,577,064.55	197,524,891.38
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	706,159.73	706,159.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,774.25	17,774.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	245,391.67	245,391.67
应付托管费	-	-	-	-	-	40,898.59	40,898.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	50,299.81	50,299.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	63,609.76	63,609.76
其他负债	-	-	-	-	-	169,341.73	169,341.73
负债总计	-	-	-	-	-	1,293,475.54	1,293,475.54
利率敏感度缺口	17,375,288.75	-	9,002,476.00	-	570,062.08	169,283,589.01	196,231,415.84
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	64,946,026.29	-	-	-	-	-	64,946,026.29
结算备付金	22,778,586.62	-	-	-	-	-	22,778,586.62
存出保证金	2,137,260.64	-	-	-	-	-	2,137,260.64
交易性金融资产	-	3,946,420.80	3,269,448.90	-	3,518.46	117,166,946.46	124,386,334.62
应收利息	-	-	-	-	-	129,472.83	129,472.83
应收申购款	-	-	-	-	-	7,513.47	7,513.47
资产总计	89,861,873.55	3,946,420.80	3,269,448.90	-	3,518.46	117,303,932.76	214,385,194.47
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	23,546,088.08	23,546,088.08
应付赎回款	-	-	-	-	-	124,583.53	124,583.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	145,889.07	145,889.07
应付托管费	-	-	-	-	-	24,314.82	24,314.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	78,815.45	78,815.45
其他负债	-	-	-	-	-	169,300.00	169,300.00
负债总计	-	-	-	-	-	24,088,990.92	24,088,990.92

						0.95	.95
利率敏感度缺 口	89,861,873.55	3,946,420.80	3,269,448.90	-	3,518.46	93,214,941.81	190,296,203.52

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	利率增加 25 基准点	-20,363.20	-6,429.98
	利率减少 25 基准点	20,529.56	6,450.47

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	169,764,539.85	86.51	117,166,946.46	61.57
交易性金融资产	-	-	-	-

一基金投资				
交易性金融资产 —债券投资	9,572,538.08	4.88	7,219,388.16	3.79
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	179,337,077.93	91.39	124,386,334.62	65.36

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%	11,951,686.85	8,540,977.84
	业绩比较基准减少 5%	-11,951,686.85	-8,540,977.84

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 168,832,592.53 元，属于第二层次的余额为 9,375,030.45 元，属于第三层次的余额为 1,129,454.95 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 112,375,054.18 元，第二层次 12,011,280.44 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

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产-股票投资。于 2021 年 1 月 1 日，本基金未持有第三层次资产。2021 年度购买第三层次资产金额为 430,348.85 元，计入当期损益的利得或损失金额为 699,106.10 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为 1,129,454.95 元。2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额为 699,106.10 元。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(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	169,764,539.85	85.95
	其中：股票	169,764,539.85	85.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,572,538.08	4.85
	其中：债券	9,572,538.08	4.85
	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	6,500,000.00	3.29
	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	7,647,757.59	3.87
8	其他各项资产	4,040,055.86	2.05
9	合计	197,524,891.38	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。

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	-	-
B	采矿业	3,816,969.95	1.95
C	制造业	111,209,671.87	56.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,360,621.00	0.69

E	建筑业	5,422,562.80	2.76
F	批发和零售业	1,189,864.91	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	2,316,257.20	1.18
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,702,077.84	5.45
J	金融业	23,488,607.63	11.97
K	房地产业	3,845,654.25	1.96
L	租赁和商务服务业	2,937,532.75	1.50
M	科学研究和技术服务业	3,303,562.16	1.68
N	水利、环境和公共设施管理业	11,333.79	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	137,053.92	0.07
S	综合	-	-
	合计	169,764,539.85	86.51

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。

8.2.2 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

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	2,956	6,059,800.00	3.09
2	002810	山东赫达	93,700	5,769,109.00	2.94
3	002003	伟星股份	413,647	5,302,954.54	2.70
4	600570	恒生电子	69,270	4,305,130.50	2.19
5	600036	招商银行	86,650	4,220,721.50	2.15
6	002430	杭氧股份	140,545	4,217,755.45	2.15
7	300750	宁德时代	7,100	4,174,800.00	2.13
8	002254	泰和新材	179,300	3,516,073.00	1.79
9	000333	美的集团	45,900	3,387,879.00	1.73
10	000739	普洛药业	93,400	3,277,406.00	1.67
11	601318	中国平安	62,000	3,125,420.00	1.59
12	601012	隆基股份	32,940	2,839,428.00	1.45
13	000858	五粮液	12,300	2,738,718.00	1.40
14	600745	闻泰科技	20,816	2,691,508.80	1.37
15	600030	中信证券	100,000	2,641,000.00	1.35
16	300661	圣邦股份	8,386	2,591,274.00	1.32

17	601888	中国中免	11,675	2,561,611.75	1.31
18	002410	广联达	38,000	2,431,240.00	1.24
19	601668	中国建筑	436,400	2,182,000.00	1.11
20	600309	万华化学	19,650	1,984,650.00	1.01
21	002129	中环股份	44,200	1,845,350.00	0.94
22	601166	兴业银行	96,725	1,841,644.00	0.94
23	000799	酒鬼酒	8,000	1,700,000.00	0.87
24	600585	海螺水泥	42,175	1,699,652.50	0.87
25	600183	生益科技	70,277	1,655,023.35	0.84
26	000895	双汇发展	51,500	1,624,825.00	0.83
27	300408	三环集团	34,600	1,543,160.00	0.79
28	300274	阳光电源	10,500	1,530,900.00	0.78
29	688008	澜起科技	17,580	1,474,434.60	0.75
30	000002	万科 A	71,000	1,402,960.00	0.71
31	603906	龙蟠科技	37,100	1,374,184.00	0.70
32	601899	紫金矿业	140,900	1,366,730.00	0.70
33	603538	美诺华	38,100	1,352,931.00	0.69
34	603259	药明康德	11,304	1,340,428.32	0.68
35	688299	长阳科技	40,338	1,319,052.60	0.67
36	000661	长春高新	4,800	1,302,720.00	0.66
37	600048	保利发展	75,575	1,181,237.25	0.60
38	002594	比亚迪	4,400	1,179,728.00	0.60
39	600031	三一重工	50,375	1,148,550.00	0.59
40	000001	平安银行	68,900	1,135,472.00	0.58
41	600039	四川路桥	93,200	1,122,128.00	0.57
42	603324	盛剑环境	18,800	1,102,808.00	0.56
43	300347	泰格医药	8,500	1,086,300.00	0.55
44	300059	东方财富	28,460	1,056,150.60	0.54
45	600588	用友网络	29,200	1,047,696.00	0.53
46	002460	赣锋锂业	7,100	1,014,235.00	0.52
47	000630	铜陵有色	289,500	1,007,460.00	0.51
48	002475	立讯精密	20,300	998,760.00	0.51
49	002179	中航光电	9,800	985,488.00	0.50
50	600859	王府井	36,463	984,501.00	0.50
51	601669	中国电建	121,600	982,528.00	0.50
52	300014	亿纬锂能	8,300	980,894.00	0.50
53	601021	春秋航空	17,200	976,960.00	0.50
54	600223	鲁商发展	72,000	954,000.00	0.49
55	600887	伊利股份	22,800	945,288.00	0.48
56	002409	雅克科技	11,600	941,572.00	0.48
57	600399	抚顺特钢	37,600	931,352.00	0.47
58	601601	中国太保	34,125	925,470.00	0.47

59	002371	北方华创	2,500	867,550.00	0.44
60	000725	京东方 A	171,700	867,085.00	0.44
61	002241	歌尔股份	15,900	860,190.00	0.44
62	600346	恒力石化	37,000	849,890.00	0.43
63	002372	伟星新材	34,900	848,768.00	0.43
64	600690	海尔智家	28,375	848,128.75	0.43
65	601658	邮储银行	160,700	819,570.00	0.42
66	300957	贝泰妮	4,229	813,152.12	0.41
67	300037	新宙邦	7,075	799,475.00	0.41
68	603986	兆易创新	4,500	791,325.00	0.40
69	002230	科大讯飞	14,800	777,148.00	0.40
70	002142	宁波银行	19,910	762,154.80	0.39
71	601328	交通银行	162,825	750,623.25	0.38
72	000651	格力电器	20,000	740,600.00	0.38
73	600171	上海贝岭	28,400	728,744.00	0.37
74	600900	长江电力	31,900	724,130.00	0.37
75	601800	中国交建	83,000	712,140.00	0.36
76	688111	金山办公	2,601	689,265.00	0.35
77	300124	汇川技术	9,650	661,990.00	0.34
78	300003	乐普医疗	29,200	660,796.00	0.34
79	000776	广发证券	26,100	641,799.00	0.33
80	600406	国电南瑞	15,780	631,673.40	0.32
81	600837	海通证券	49,525	607,176.50	0.31
82	002568	百润股份	10,040	600,693.20	0.31
83	600000	浦发银行	69,125	589,636.25	0.30
84	002271	东方雨虹	11,000	579,480.00	0.30
85	603396	金辰股份	4,700	578,100.00	0.29
86	601088	中国神华	25,650	577,638.00	0.29
87	300049	福瑞股份	38,100	560,070.00	0.29
88	300132	青松股份	48,700	549,823.00	0.28
89	600886	国投电力	47,700	547,119.00	0.28
90	600276	恒瑞医药	10,693	542,242.03	0.28
91	300474	景嘉微	3,400	517,480.00	0.26
92	601688	华泰证券	28,800	511,488.00	0.26
93	600196	复星医药	10,450	511,423.00	0.26
94	601838	成都银行	42,100	505,200.00	0.26
95	600438	通威股份	11,200	503,552.00	0.26
96	600176	中国巨石	27,021	491,782.20	0.25
97	600016	民生银行	125,400	489,060.00	0.25
98	603799	华友钴业	4,400	485,364.00	0.25
99	600188	兖矿能源	20,400	480,012.00	0.24
100	688368	晶丰明源	1,476	472,467.60	0.24

101	600660	福耀玻璃	9,900	466,686.00	0.24
102	601555	东吴证券	52,130	461,871.80	0.24
103	603690	至纯科技	9,200	442,980.00	0.23
104	002415	海康威视	8,300	434,256.00	0.22
105	000568	泸州老窖	1,700	431,579.00	0.22
106	688037	芯源微	2,531	427,232.80	0.22
107	600460	士兰微	7,700	417,340.00	0.21
108	601919	中远海控	22,280	416,413.20	0.21
109	600703	三安光电	10,850	407,526.00	0.21
110	601901	方正证券	50,100	392,784.00	0.20
111	601211	国泰君安	21,875	391,343.75	0.20
112	300285	国瓷材料	9,100	387,387.00	0.20
113	601988	中国银行	124,275	379,038.75	0.19
114	002027	分众传媒	45,900	375,921.00	0.19
115	600563	法拉电子	1,600	371,840.00	0.19
116	600801	华新水泥	18,500	357,050.00	0.18
117	600104	上汽集团	17,050	351,741.50	0.18
118	002812	恩捷股份	1,400	350,560.00	0.18
119	300363	博腾股份	3,900	348,855.00	0.18
120	603027	千禾味业	14,300	344,344.00	0.18
121	688202	美迪西	702	340,884.18	0.17
122	603993	洛阳钼业	59,300	330,894.00	0.17
123	603290	斯达半导	856	326,136.00	0.17
124	000513	丽珠集团	8,000	321,680.00	0.16
125	688186	广大特材	7,150	318,961.50	0.16
126	688678	福立旺	9,544	312,947.76	0.16
127	601168	西部矿业	22,600	307,586.00	0.16
128	601818	光大银行	92,300	306,436.00	0.16
129	300760	迈瑞医疗	800	304,640.00	0.16
130	002821	凯莱英	700	304,500.00	0.16
131	002236	大华股份	12,400	291,152.00	0.15
132	688082	盛美上海	2,240	286,272.00	0.15
133	002304	洋河股份	1,700	280,041.00	0.14
134	603501	韦尔股份	900	279,693.00	0.14
135	688690	纳微科技	3,477	277,534.14	0.14
136	601857	中国石油	56,025	275,082.75	0.14
137	600028	中国石化	64,200	271,566.00	0.14
138	688385	复旦微电	5,322	258,542.76	0.13
139	600893	航发动力	3,900	247,494.00	0.13
140	601618	中国中冶	64,100	245,503.00	0.13
141	600019	宝钢股份	33,900	242,724.00	0.12
142	601628	中国人寿	8,050	242,224.50	0.12

143	600872	中炬高新	6,200	235,414.00	0.12
144	603127	昭衍新药	2,000	230,860.00	0.12
145	600600	青岛啤酒	2,300	227,700.00	0.12
146	002352	顺丰控股	3,300	227,436.00	0.12
147	600009	上海机场	4,700	219,443.00	0.11
148	603885	吉祥航空	12,300	218,325.00	0.11
149	600875	东方电气	9,700	207,774.00	0.11
150	600111	北方稀土	4,500	206,100.00	0.11
151	601128	常熟银行	30,800	203,588.00	0.10
152	000538	云南白药	1,900	198,835.00	0.10
153	300601	康泰生物	2,000	197,080.00	0.10
154	601989	中国重工	43,725	184,519.50	0.09
155	002080	中材科技	5,200	176,904.00	0.09
156	600050	中国联通	45,000	176,850.00	0.09
157	601186	中国铁建	22,250	173,550.00	0.09
158	600547	山东黄金	8,860	166,745.20	0.08
159	000703	恒逸石化	15,700	166,734.00	0.08
160	600383	金地集团	12,700	164,719.00	0.08
161	688711	宏微科技	1,317	163,189.47	0.08
162	000963	华东医药	4,000	160,800.00	0.08
163	601336	新华保险	4,075	158,436.00	0.08
164	603129	春风动力	900	155,700.00	0.08
165	603309	维力医疗	9,500	150,385.00	0.08
166	300357	我武生物	2,600	148,980.00	0.08
167	688733	壹石通	1,969	148,383.84	0.08
168	000338	潍柴动力	8,200	146,698.00	0.07
169	603659	璞泰来	900	144,549.00	0.07
170	000100	TCL 科技	23,200	143,144.00	0.07
171	001979	招商蛇口	10,700	142,738.00	0.07
172	688032	禾迈股份	200	140,798.00	0.07
173	688601	力芯微	915	138,897.00	0.07
174	002049	紫光国微	600	135,000.00	0.07
175	300413	芒果超媒	2,100	120,162.00	0.06
176	000723	美锦能源	7,400	120,102.00	0.06
177	000786	北新建材	3,300	118,239.00	0.06
178	301101	明月镜片	2,184	116,352.54	0.06
179	688097	博众精工	2,489	116,136.74	0.06
180	601138	工业富联	9,625	114,730.00	0.06
181	002202	金风科技	6,900	113,643.00	0.06
182	601598	中国外运	25,100	112,448.00	0.06
183	000625	长安汽车	7,400	112,406.00	0.06
184	300034	钢研高纳	1,900	109,440.00	0.06

185	603160	汇顶科技	1,000	107,770.00	0.05
186	002466	天齐锂业	1,000	107,000.00	0.05
187	600926	杭州银行	8,300	106,406.00	0.05
188	603806	福斯特	800	104,440.00	0.05
189	000878	云南铜业	7,800	104,286.00	0.05
190	002311	海大集团	1,400	102,620.00	0.05
191	688248	南网科技	5,419	102,419.10	0.05
192	600380	健康元	7,900	101,436.00	0.05
193	002493	荣盛石化	5,300	96,248.00	0.05
194	300073	当升科技	1,100	95,557.00	0.05
195	601600	中国铝业	15,300	93,177.00	0.05
196	002643	万润股份	3,600	85,104.00	0.04
197	002050	三花智控	3,300	83,490.00	0.04
198	300595	欧普康视	1,400	80,318.00	0.04
199	000938	紫光股份	3,500	79,975.00	0.04
200	688227	品高股份	2,394	76,799.52	0.04
201	300009	安科生物	5,720	74,874.80	0.04
202	301100	风光股份	1,982	72,257.01	0.04
203	603707	健友股份	1,700	71,400.00	0.04
204	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.04
205	601816	京沪高铁	14,300	69,069.00	0.04
206	601009	南京银行	7,700	68,992.00	0.04
207	688262	国芯科技	1,642	68,931.16	0.04
208	301136	招标股份	6,190	65,118.80	0.03
209	688210	统联精密	1,478	61,277.88	0.03
210	301189	奥尼电子	1,013	60,453.46	0.03
211	603486	科沃斯	400	60,380.00	0.03
212	000400	许继电气	2,300	60,030.00	0.03
213	601100	恒立液压	700	57,260.00	0.03
214	600795	国电电力	17,800	56,426.00	0.03
215	688265	南模生物	792	55,479.60	0.03
216	688091	上海谊众	1,284	54,968.04	0.03
217	600018	上港集团	9,400	51,512.00	0.03
218	300433	蓝思科技	2,200	50,556.00	0.03
219	300122	智飞生物	400	49,840.00	0.03
220	301096	百诚医药	576	49,056.12	0.02
221	601319	中国人保	10,400	48,880.00	0.02
222	601877	正泰电器	900	48,501.00	0.02
223	688236	春立医疗	1,741	47,685.99	0.02
224	600132	重庆啤酒	300	45,396.00	0.02
225	600885	宏发股份	600	44,784.00	0.02
226	002920	德赛西威	300	42,453.00	0.02

227	601699	潞安环能	3,600	40,716.00	0.02
228	603338	浙江鼎力	500	40,130.00	0.02
229	002180	纳思达	800	38,208.00	0.02
230	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.02
231	600426	华鲁恒升	1,200	37,560.00	0.02
232	002242	九阳股份	1,500	34,800.00	0.02
233	600011	华能国际	3,400	32,946.00	0.02
234	601111	中国国航	2,700	24,651.00	0.01
235	601236	红塔证券	2,000	23,840.00	0.01
236	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
237	301029	怡合达	263	23,635.81	0.01
238	301058	中粮工科	1,254	22,872.96	0.01
239	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.01
240	600329	中新药业	600	18,846.00	0.01
241	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
242	300994	久祺股份	344	15,634.80	0.01
243	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
244	301089	拓新药业	195	13,246.35	0.01
245	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
246	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
247	601066	中信建投	425	12,431.25	0.01
248	301013	利和兴	471	12,104.70	0.01
249	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
250	301185	鸥玛软件	538	11,384.08	0.01
251	301035	润丰股份	202	11,368.56	0.01
252	301155	海力风电	117	11,319.75	0.01
253	301015	百洋医药	362	10,968.60	0.01
254	301011	华立科技	175	10,535.00	0.01
255	301126	达嘉维康	541	10,403.43	0.01
256	301177	迪阿股份	86	9,982.88	0.01
257	002463	沪电股份	600	9,948.00	0.01
258	301048	金鹰重工	737	9,551.52	0.00
259	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
260	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
261	301138	华研精机	200	8,972.00	0.00
262	301188	力诺特玻	423	8,663.04	0.00
263	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
264	301221	光庭信息	96	8,517.12	0.00
265	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
266	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
267	301039	中集车辆	651	8,144.01	0.00
268	301066	万事利	344	7,856.96	0.00

269	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
270	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
271	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
272	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
273	301118	恒光股份	154	7,549.08	0.00
274	301168	通灵股份	141	7,350.33	0.00
275	301028	东亚机械	543	7,330.50	0.00
276	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
277	301198	喜悦智行	232	6,774.40	0.00
278	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
279	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
280	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
281	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
282	301182	凯旺科技	208	6,360.64	0.00
283	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
284	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
285	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
286	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
287	301081	严牌股份	345	6,016.80	0.00
288	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
289	301049	超越科技	176	5,793.92	0.00
290	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
291	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
292	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
293	301190	善水科技	196	5,382.16	0.00
294	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
295	301036	双乐股份	177	5,297.61	0.00
296	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
297	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
298	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
299	301179	泽宇智能	98	4,975.46	0.00
300	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
301	301193	家联科技	162	4,720.68	0.00
302	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
303	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
304	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
305	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
306	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
307	301108	洁雅股份	76	4,081.96	0.00
308	301093	华兰股份	74	3,688.90	0.00
309	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	002003	伟星股份	7,711,807.20	4.05
2	300750	宁德时代	5,887,579.00	3.09
3	002430	杭氧股份	4,444,444.00	2.34
4	300661	圣邦股份	3,961,583.20	2.08
5	000002	万科 A	3,931,753.00	2.07
6	000858	五粮液	3,805,682.00	2.00
7	000739	普洛药业	3,759,172.00	1.98
8	000333	美的集团	3,604,883.00	1.89
9	000799	酒鬼酒	3,578,345.69	1.88
10	002410	广联达	3,557,677.00	1.87
11	600570	恒生电子	3,424,093.80	1.80
12	300274	阳光电源	3,232,911.84	1.70
13	603027	千禾味业	3,178,350.96	1.67
14	000661	长春高新	3,056,395.00	1.61
15	300037	新宙邦	3,046,894.00	1.60
16	300258	精锻科技	3,035,708.00	1.60
17	000651	格力电器	2,950,824.77	1.55
18	601012	隆基股份	2,822,234.20	1.48
19	600745	闻泰科技	2,738,381.00	1.44
20	603906	龙蟠科技	2,729,567.00	1.43

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	300661	圣邦股份	6,757,164.00	3.55
2	002409	雅克科技	5,824,670.18	3.06
3	002003	伟星股份	5,783,847.66	3.04
4	300274	阳光电源	5,154,276.00	2.71
5	601318	中国平安	4,546,947.00	2.39
6	601012	隆基股份	4,251,234.00	2.23
7	600519	贵州茅台	4,108,303.38	2.16
8	300258	精锻科技	3,786,883.00	1.99
9	688368	晶丰明源	3,655,311.88	1.92
10	000739	普洛药业	3,633,306.00	1.91
11	002430	杭氧股份	3,545,148.00	1.86

12	600036	招商银行	2,886,065.47	1.52
13	000799	酒鬼酒	2,839,866.00	1.49
14	600745	闻泰科技	2,634,778.80	1.38
15	600887	伊利股份	2,627,992.50	1.38
16	002371	北方华创	2,516,288.97	1.32
17	600276	恒瑞医药	2,472,363.53	1.30
18	300037	新宙邦	2,327,423.00	1.22
19	000661	长春高新	2,311,539.00	1.21
20	002254	泰和新材	2,236,710.00	1.18

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	221,913,049.63
卖出股票收入（成交）总额	191,760,777.94

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	9,002,476.00	4.59
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）	570,062.08	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,572,538.08	4.88

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	019658	21 国债 10	90,160	9,002,476.00	4.59
2	113050	南银转债	2,640	312,364.80	0.16
3	113052	兴业转债	2,330	233,000.00	0.12

4	127046	百润转债	151	20,723.24	0.01
5	127036	三花转债	28	3,974.04	0.00

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

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
IF2203	IF2203	-18	-26,733,240.00	-608,040.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-608,040.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,023,372.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					336,540.00

8.10.2 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。

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	3,227,531.16
2	应收证券清算款	709,378.37
3	应收股利	-
4	应收利息	81,586.74
5	应收申购款	21,559.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,040,055.86

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113050	南银转债	312,364.80	0.16
2	127036	三花转债	3,974.04	0.00

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

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 (%)
工银新价值灵活配	710	87,461.63	54,430,378.05	87.65	7,667,377.98	12.35

置混合 A						
工银新价值灵活配置混合 C	108	678,660.42	73,111,008.39	99.75	184,316.66	0.25
合计	818	165,517.21	127,541,386.44	94.20	7,851,694.64	5.80

9.2 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	工银新价值灵活配置混合 A	-	-
	工银新价值灵活配置混合 C	15.50	0.00
	合计	15.50	0.00

9.3 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	工银新价值灵活配置混合 A	0
	工银新价值灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银新价值灵活配置混合 A	0
	工银新价值灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银新价值灵活配置混合 A	工银新价值灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2017年4月27日) 基金份额总额	238,050,824.68	-
本报告期期初基金份额总额	147,897,070.45	-
本报告期基金总申购份额	32,496,721.04	114,048,425.02
减：本报告期基金总赎回份额	118,296,035.46	40,753,099.97
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	62,097,756.03	73,295,325.05
-------------	---------------	---------------

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：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦字任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

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 40,000.00 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	1	118,516,898.56	29.31%	84,301.27	30.23%	-
兴业证券	2	101,731,345.46	25.16%	72,360.28	25.95%	-
申万宏源	1	81,885,253.91	20.25%	58,244.68	20.89%	-
中信建投	2	56,629,149.29	14.00%	34,617.34	12.41%	-
国泰君安	1	31,138,959.07	7.70%	19,034.78	6.83%	-
广发证券	3	8,239,029.18	2.04%	5,860.13	2.10%	-
华西证券	2	6,143,238.44	1.52%	4,369.59	1.57%	-
华泰证券	2	89,866.00	0.02%	63.90	0.02%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

西南证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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。

本报告期内本基金新增德邦证券 2 个交易单元，新增华西证券 2 个交易单元。

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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证

		比例		成交总额的 比例		成交总额的 比例
中信证券	8,502,191.94	37.91%	-	-	-	-
兴业证券	9,327,929.50	41.59%	925,200,000.00	40.50%	-	-
申万宏源	4,598,492.40	20.50%	899,700,000.00	39.38%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	267,500,000.00	11.71%	-	-
广发证券	-	-	69,000,000.00	3.02%	-	-
华西证券	-	-	90,000,000.00	3.94%	-	-
华泰证券	-	-	33,000,000.00	1.44%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证监会规定的媒介	2021年1月29日

	金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告		
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	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额和侧袋机制并相应修改基金合同、托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021年5月10日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道开展部分基金赎回费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年5月31日
9	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
10	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
11	工银瑞信基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证监会规定的媒介	2021年9月6日
12	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10月27日
13	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
14	工银瑞信基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证监会规定的媒介	2021年12月18日
15	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	20210101-20210103	31,009,148.72	-	31,009,148.72	-	-
	2	20210101-20210531	25,667,877.31	-	25,667,877.31	-	-

	3	20210628-20210809		29,945,672.05	25,925,925.93	4,019,746.12	2.97
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

工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，对《基金合同》和《托管协议》进行了修订，并增加 C 类基金份额，修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 5 月 11 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新价值灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

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

工银瑞信基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日