

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金	
基金简称	工银美丽城镇股票	
基金主代码	001043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,071,800,084.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
下属分级基金的交易代码	001043	011478
报告期末下属分级基金的份额总额	828,207,196.84 份	243,592,887.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在全面推进新型城镇化发展的背景下，积极选择深度受益于此类主题的股票进行投资，并通过积极有效的风险防范措施，力争获取超越业绩比较基准的收益。
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，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情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。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
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
		李申
		021-60637102
		lishen.zh@ccb.com

客户服务电话	400-811-9999	021-60637111
传真	010-66583158	021-60635778
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	赵桂才	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
本期已实现收益	-8,864,388.84	-4,352,798.89
本期利润	-49,833,718.74	25,580,309.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0648	0.1689
本期加权平均净值利润率	-2.49%	6.59%
本期基金份额净值增长率	-3.97%	-4.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	1,283,137,888.29	373,264,893.42

期末可供分配基金份额利润	1.5493	1.5323
期末基金资产净值	2,281,670,724.36	666,931,440.55
期末基金份额净值	2.755	2.738
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	175.50%	-3.59%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银美丽城镇股票 A

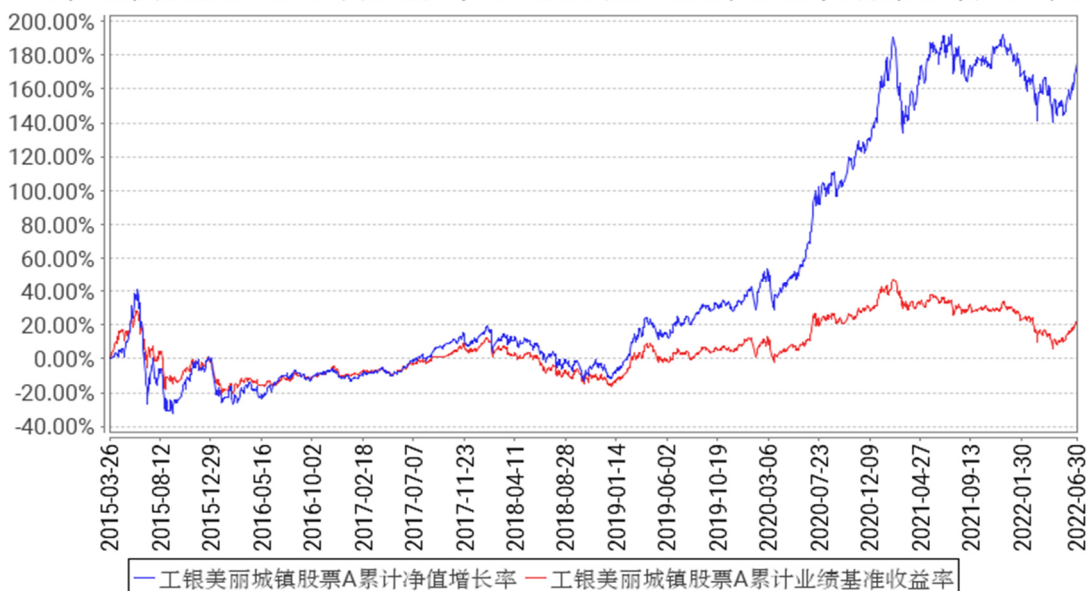
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.94%	1.03%	7.64%	0.86%	2.30%	0.17%
过去三个月	4.36%	1.31%	5.26%	1.14%	-0.90%	0.17%
过去六个月	-3.97%	1.37%	-6.92%	1.16%	2.95%	0.21%
过去一年	-5.55%	1.25%	-10.39%	1.00%	4.84%	0.25%
过去三年	127.12%	1.32%	17.55%	1.01%	109.57%	0.31%
自基金合同生效起至今	175.50%	1.61%	21.66%	1.17%	153.84%	0.44%

工银美丽城镇股票 C

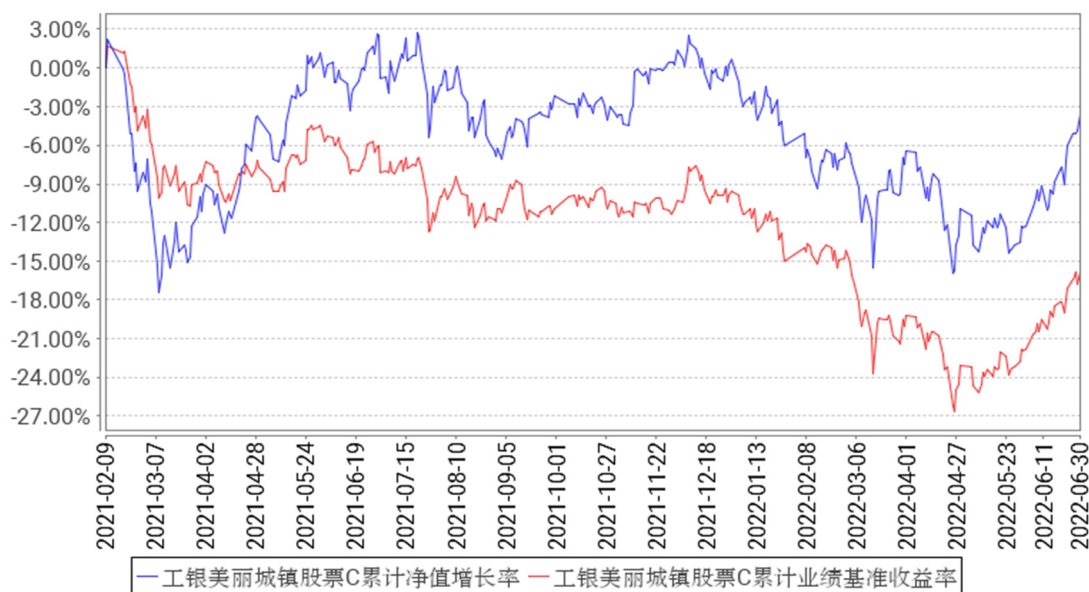
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.87%	1.03%	7.64%	0.86%	2.23%	0.17%
过去三个月	4.23%	1.32%	5.26%	1.14%	-1.03%	0.18%
过去六个月	-4.20%	1.37%	-6.92%	1.16%	2.72%	0.21%
过去一年	-6.01%	1.25%	-10.39%	1.00%	4.38%	0.25%
自基金合同生效起至今	-3.59%	1.34%	-15.84%	1.00%	12.25%	0.34%

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

工银美丽城镇股票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



工银美丽城镇股票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 2015 年 3 月 26 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，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 2 月 9 日增加 C 类份额类别。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是由中国工商银行和瑞士信贷合资设立的基金管理公司，成立于 2005 年 6 月。目前，公司在北京、上海、深圳等地设有分公司，分别在香港和上海设有全资子公司-工银瑞信资产管理(国际)有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

自成立以来，公司坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足专业化、综合化、国际化、数字化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资、绿色投资、责任投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、私募资产管理计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、

企业年金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII、公募基金投顾等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

工银瑞信(含子公司)以持续优秀的投资业绩、完善周到的服务，为逾 7700 万境内外个人和机构投资者提供涵盖公募与私募、上市与非上市、境内与跨境业务的财富管理服务，赢得了广大基金投资人、企业年金客户、私募资产管理计划客户等的认可和信赖。截至 2022 年 6 月 30 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 216 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模 1.78 万亿元，养老金管理规模居行业领先。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王君正	研究部副总经理、投资总监、本基金的基金经理	2015 年 3 月 26 日	-	14 年	曾任泰达宏利基金管理有限公司研究员；2011 年加入工银瑞信，现任研究部副总经理、投资总监、金融地产研究团队负责人、基金经理。2013 年 8 月 26 日至今，担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2015 年 1 月 27 日至 2018 年 2 月 27 日，担任工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金基金经理；2015 年 3 月 19 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银瑞信新金融股票型证券投资基金基金经理；2015 年 3 月 26 日至今，担任工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月 22 日至今，担任工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 11 月 14 日至今，担任工银瑞信精选金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2019 年 2 月 11 日至今，担任工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金经理；2020 年 11 月 24 日至今，担任工银瑞信优质成长混合型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》的相关规定。

3、根据 2022 年 8 月 23 日发布的《关于工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金增聘基金经理的公告》，胡志利先生自 2022 年 8 月 22 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年年初在稳增长政策的支持下，经济显现出触底回升的迹象。但3月份的俄乌冲突加重了能源、粮食价格上涨带来的通胀压力，稳增长政策落地的难度提升。同时，国内局部地区的疫情影响内需，一季度经济增长低于年初预期。步入二季度，国内部分城市疫情冲击显著超出预期，物流运输和汽车、半导体等行业供应链一度出现较大问题，经济基本面受到较大影响。同时，受疫情影响，不确定性增加，居民收入预期转差，社会消费负增长；地产销售数据也出现大幅下滑。5月份之后，随着疫情防控政策逐步优化、国务院三十三条等稳增长政策发力、流动性更为宽松，经济数据企稳改善，二季度经济增长呈现底部回升态势。尽管不确定性仍存，但预计经济大概率将步入温和复苏的通道中。

市场表现方面，年初市场对于稳增长抱有较为乐观的预期，但由于赛道行业持仓较为集中、交易较为拥挤，同时市场担忧美联储加息制约国内货币政策空间，市场出现较大幅度的调整，期间依托稳增长政策受益的建筑、地产等行业表现较好。俄乌冲突提升了通胀预期，给制造业企业盈利带来压力，同时引发了地缘冲突升级的担忧，加剧了市场下跌的幅度。金稳委表态提振了市场信心，改变了加速下跌的趋势，市场开始企稳反弹。但 4 月份的国内局部地区疫情又给市场带来较大幅度的冲击，投资者预期一度转向悲观，4 月中下旬出现了快速下跌。5 月份，随着复工复产持续推进、疫情防控政策优化、流动性进一步宽松，市场企稳反弹，并在新能源车销量亮眼、地产销售有所改善的数据支撑下持续上行。

操作方面，基金加仓银行、有色、电子，减仓非银、地产、军工。

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-3.97%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为-6.92%，本基金 C 份额净值增长率为-4.20%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-6.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，内需的政策发力和疫情冲击交织的背景下持续修复，外需仍存在不确定性，预计经济大概率处于弱复苏的通道之中。从内需修复的角度看，政策端保持一定的支持力度，同时政策的稳定性预计有所增强；防疫措施进一步优化，预计经济运行受到的扰动将会减小；行业监管已经取得一定成效，未来可以给企业带来稳定的经营环境。整体看，内需修复和经济运行回归正常将带来经济增长和企业盈利的恢复。但相比于过往，经济恢复过程中的潜在不确定性依然较大。美联储控通胀背景下，美国经济软着陆或非大概率事件，这意味着中国经济面临的外部环境恶化的潜在风险依然较高，外需下行的压力始终存在。同时，国内下半年 CPI 仍然存在上行压力，地产行业供给侧的调整还不明朗。总体看，在不确定性交织的环境下，经济弱复苏或是大概率事件。

在国内弱复苏、海外经济潜在回落压力大的环境下，预计市场还将维持高波动性的特征，整体可能呈现震荡格局。由于此前的悲观预期已经得到修复，考虑到短端利率已经很低，流动性进一步宽松的可能性有限。当前市场整体估值已经回归到相对合理位置，估值系统性提升的机会有限。未来市场上行的主要驱动力将由流动性转为基本面改善。由于前述内外需遇到的情况（在美联储的持续加息下海外需求端回落是大概率事件，国内由于地产行业的结构性问题，需求端的大幅改善难度较大），预计国内企业盈利下半年难以复制 2020 年疫情后的修复路径，更有可能体现为有限幅度的改善。在这种环境下，基金经理将重点寻求以下几个方面的结构性机会：一是重视高景气行业，如光伏、新能源车等行业的投资机会；二是关注估值合理、拥挤度不高的医药行业；

三是注重观察稳增长受益行业的积极变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	409,005,473.20	299,108,179.26
结算备付金		1,078,199.64	2,004,035.91
存出保证金		559,272.79	406,476.82
交易性金融资产	6.4.7.2	2,545,677,344.46	1,682,077,380.44
其中：股票投资		2,538,845,231.59	1,681,706,024.88
基金投资		-	-
债券投资		6,832,112.87	371,355.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		13,105,860.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,691,287.36	1,002,099.25

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	37,101.49
资产总计		2,972,117,437.88	1,984,635,273.17
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,884,001.80	21,337,307.45
应付赎回款		12,131,811.02	1,932,717.07
应付管理人报酬		3,412,351.68	2,106,047.97
应付托管费		568,725.28	351,008.00
应付销售服务费		261,656.39	55,390.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.04	2.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,256,723.76	1,507,199.17
负债合计		23,515,272.97	27,289,671.77
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,071,800,084.00	682,529,983.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,876,802,080.91	1,274,815,617.72
净资产合计		2,948,602,164.91	1,957,345,601.40
负债和净资产总计		2,972,117,437.88	1,984,635,273.17

注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。

2、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额为 1,071,800,084.00 份，其中工银美丽城镇股票 A 基金份额总额为 828,207,196.84 份，基金份额净值 2.755 元；工银美丽城镇股票 C 基金份额总额为 243,592,887.16 份，基金份额净值 2.738 元。

3、比较数据已根据《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额，下同。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,506,123.03	198,023,766.21
1. 利息收入		581,305.27	383,093.53
其中：存款利息收入	6.4.7.13	581,305.27	353,385.00
债券利息收入		-	295.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	29,412.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,980,812.08	97,826,190.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,572,614.38	90,520,154.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	45,660.20	580,129.87
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,507,766.26	6,725,906.65
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-11,036,221.79	98,537,678.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	967,981.41	1,276,803.68
减：二、营业总支出		21,747,286.49	13,833,075.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,727,050.17	9,272,061.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,954,508.37	1,545,343.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	953,648.99	70,059.57
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.81	1.07
8. 其他费用	6.4.7.23	112,078.15	2,945,610.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,253,409.52	184,190,690.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,253,409.52	184,190,690.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,253,409.52	184,190,690.24

注：比较数据已根据《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额，下同。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	682,529,983.68	-	1,274,815,617.72	1,957,345,601.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	682,529,983.68	-	1,274,815,617.72	1,957,345,601.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	389,270,100.32	-	601,986,463.19	991,256,563.51

(一)、综合收益总额	-	-	-24,253,409.52	-24,253,409.52
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	389,270,100.32	-	626,239,872.71	1,015,509,973.03
其中：1. 基金申购款	647,449,537.47	-	1,031,840,322.63	1,679,289,860.10
2. 基金赎回款	-258,179,437.15	-	-405,600,449.92	-663,779,887.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,071,800,084.00	-	1,876,802,080.91	2,948,602,164.91
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	346,376,792.21	-	515,313,760.96	861,690,553.17
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期 差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净资 产（基 金净 值）	346,376,792.21	-	515,313,760.96	861,690,553.17
三、本 期增 减变 动额 （减 少以 “-” 号填 列）	357,883,682.58	-	834,725,058.54	1,192,608,741.12
（一）、 综合收 益总 额	-	-	184,190,690.24	184,190,690.24
（二）、 本期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 （净 值减 少以 “-” 号填 列）	357,883,682.58	-	650,534,368.30	1,008,418,050.88
其中：1. 基金申 购款	534,137,722.76	-	929,104,444.59	1,463,242,167.35
2. 基金赎 回款	-176,254,040.18	-	-278,570,076.29	-454,824,116.47
（三）、 本期向 基金 份额 持有 人分 配利 润产 生的 基金 净值 变动 （净 值减 少以 “-” 号填 列）	-	-	-	-
（四）、 其他综 合收 益结 转留 存收 益	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	704,260,474.79	-	1,350,038,819.50	2,054,299,294.29
-----------------	----------------	---	------------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]96 号文《关于准予工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2015 年 3 月 26 日正式生效，首次设立募集规模为 2,380,276,036.62 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年

度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

1、金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整

个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

3、收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日

计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金

融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示。同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金持有的金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的具体结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购和其他资产，金额分别为 299,108,179.26 元、2,004,035.91 元、406,476.82 元、0.00 元、0.00 元、37,101.49 元、0.00 元、1,002,099.25 元、0.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、其他资产-应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 299,143,747.68 元、2,005,027.89 元、406,678.01 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、1,002,099.25 元、0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,682,077,380.44 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,682,077,720.34 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为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、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，金额分别为 0.00 元、21,337,307.45 元、1,932,717.07 元、2,106,047.97 元、351,008.00 元、55,390.01 元、1,300,480.09 元、0.00 元、206,719.08 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.00 元、21,337,307.45 元、1,932,717.07 元、2,106,047.97 元、351,008.00 元、55,390.01 元、1,300,480.09 元、0.00 元、206,719.08 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生

的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	409,005,473.20
等于：本金	408,966,022.00
加：应计利息	39,451.20
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	409,005,473.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,441,463,071.37	-	2,538,845,231.59	97,382,160.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,643.99	6,832,112.87	1,472,768.88
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,643.99	6,832,112.87	1,472,768.88
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,446,819,771.37	2,643.99	2,545,677,344.46	98,854,929.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,099.65

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,066,945.16
其中：交易所市场	1,066,945.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	119,671.58
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	1,256,723.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银美丽城镇股票 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	626,409,142.27	626,409,142.27
本期申购	385,785,314.66	385,785,314.66
本期赎回（以“-”号填列）	-183,987,260.09	-183,987,260.09
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	828,207,196.84	828,207,196.84

工银美丽城镇股票 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,120,841.41	56,120,841.41
本期申购	261,664,222.81	261,664,222.81
本期赎回（以“-”号填列）	-74,192,177.06	-74,192,177.06
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	243,592,887.16	243,592,887.16

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

工银美丽城镇股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	978,404,172.73	192,143,533.08	1,170,547,705.81
本期利润	-8,864,388.84	-40,969,329.90	-49,833,718.74
本期基金份额交易产生的变动数	313,598,104.40	19,151,436.05	332,749,540.45
其中：基金申购款	598,614,040.40	23,771,274.52	622,385,314.92
基金赎回款	-285,015,936.00	-4,619,838.47	-289,635,774.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,283,137,888.29	170,325,639.23	1,453,463,527.52

工银美丽城镇股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	87,060,176.57	17,207,735.34	104,267,911.91
本期利润	-4,352,798.89	29,933,108.11	25,580,309.22
本期基金份额交易产生的变动数	290,557,515.74	2,932,816.52	293,490,332.26
其中：基金申购款	404,259,639.08	5,195,368.63	409,455,007.71
基金赎回款	-113,702,123.34	-2,262,552.11	-115,964,675.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	373,264,893.42	50,073,659.97	423,338,553.39

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	548,533.50
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	28,785.09
其他	3,986.68
合计	581,305.27

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,572,614.38
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	-10,572,614.38
----	----------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,334,517,533.15
减：卖出股票成本总额	1,341,130,567.81
减：交易费用	3,959,579.72
买卖股票差价收入	-10,572,614.38

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,674.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	42,985.88
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	45,660.20

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	302,370.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	259,000.00
减：应计利息总额	372.96
减：交易费用	12.13
买卖债券差价收入	42,985.88

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,507,766.26
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	17,507,766.26

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,036,221.79
股票投资	-12,451,035.11
债券投资	1,414,813.32
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	-11,036,221.79

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	962,720.92
基金转换费收入	5,260.49
合计	967,981.41

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	3,899.20
合计	112,078.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,727,050.17	9,272,061.61
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,705,179.20	1,622,789.84

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,954,508.37	1,545,343.59

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	459,382.29	459,382.29
中国工商银行股份有限公司	-	199.03	199.03
合计	-	459,581.32	459,581.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	43,368.37	43,368.37
合计	-	43,368.37	43,368.37

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 0.50% 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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
基金合同生效日（2015 年 3 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	3,732,362.82	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,732,362.82	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.45%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
基金合同生效日（2015 年 3	-	-

月 26 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份 有限公司	409,005,473.20	548,533.50	329,754,320.82	333,541.93

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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
300661	圣邦	2022	6 个月	大宗	200.87	172.69	99,600	20,006,984.00	17,199,924.00	-

	股份	年 3 月 7 日		交易 流通 受限							
600941	中国 移动	2021 年 12 月 24 日	6 个月	新股 锁定	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-	
688297	中无 人机	2022 年 6 月 17 日	6 个月	新股 锁定	32.35	45.88	37,246	1,204,908.10	1,708,846.48	-	
600938	中国 海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股 锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-	
688072	拓荆 科技	2022 年 4 月 12 日	6 个月	新股 锁定	71.88	139.78	5,300	380,964.00	740,834.00	-	
688220	翱捷 科技	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股 锁定	164.54	68.59	7,708	1,268,274.32	528,691.72	-	
688400	凌云 光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-	
688322	奥比 中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-	
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-	
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-	
688237	超卓 航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-	
301236	软通	2022	6 个月	新股	48.59	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-	

	动力	年 3 月 8 日		锁定						
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定	72.87	45.69	945	68,859.00	43,177.05	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	108.91	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301201	诚达	2022	6 个月	新股	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-

	药业	年 1 月 12 日		锁定						
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股锁定	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股锁定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301103	何氏	2022	6 个月	新股	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-

	眼科	年 3 月 14 日		锁定						
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301160	翔楼新材	2022 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新股锁定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301220	亚香	2022	6 个月	新股	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-

	股份	年 6 月 15 日		锁定						
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301279	金道	2022	6 个月	新股	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-

	科技	年 4 月 6 日		锁定						
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 20 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.02	6,513	651,300.00	651,422.77	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、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之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	6,116,186.05	-
AAA 以下	715,926.82	371,355.56
未评级	-	-
合计	6,832,112.87	371,355.56

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	409,005,473.20	-	-	-	409,005,473.20
结算备付金	1,078,199.64	-	-	-	1,078,199.64
存出保证金	559,272.79	-	-	-	559,272.79
交易性金融资产	-	1,582.42	6,830,530.45	2,538,845,231.59	2,545,677,344.46
应收清算款	-	-	-	13,105,860.43	13,105,860.43
应收申购款	-	-	-	2,691,287.36	2,691,287.36
资产总计	410,642,945.63	1,582.42	6,830,530.45	2,554,642,379.38	2,972,117,437.88

负债					
应付清算款	-	-	-	5,884,001.80	5,884,001.80
应付赎回款	-	-	-	12,131,811.02	12,131,811.02
应付管理人报酬	-	-	-	3,412,351.68	3,412,351.68
应付托管费	-	-	-	568,725.28	568,725.28
应付销售服务费	-	-	-	261,656.39	261,656.39
应付税费	-	-	-	3.04	3.04
其他负债	-	-	-	1,256,723.76	1,256,723.76
负债总计	-	-	-	23,515,272.97	23,515,272.97
利率敏感度缺口	410,642,945.63	1,582.42	6,830,530.45	2,531,127,106.41	2,948,602,164.91
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	299,108,179.26	-	-	-	299,108,179.26
结算备付金	2,004,035.91	-	-	-	2,004,035.91
存出保证金	406,476.82	-	-	-	406,476.82
交易性金融资产	-	115.57	371,239.99	1,681,706,024.88	1,682,077,380.44
应收申购款	-	-	-	1,002,099.25	1,002,099.25
其他资产	-	-	-	37,101.49	37,101.49
资产总计	301,518,691.99	115.57	371,239.99	1,682,745,225.62	1,984,635,273.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	21,337,307.45	21,337,307.45
应付赎回款	-	-	-	1,932,717.07	1,932,717.07
应付管理人报酬	-	-	-	2,106,047.97	2,106,047.97
应付托管费	-	-	-	351,008.00	351,008.00
应付销售服务费	-	-	-	55,390.01	55,390.01
应付税费	-	-	-	2.10	2.10
其他负债	-	-	-	1,507,199.17	1,507,199.17
负债总计	-	-	-	27,289,671.77	27,289,671.77
利率敏感度缺口	301,518,691.99	115.57	371,239.99	1,655,455,553.85	1,957,345,601.40

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）

分析	利率增加 25 基准点	-97,612.32	-5,063.92
	利率减少 25 基准点	99,292.36	5,147.63

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	2,538,845,231.59	86.10	1,681,706,024.88	85.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	6,832,112.87	0.23	371,355.56	0.02
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	2,545,677,344.46	86.34	1,682,077,380.44	85.94

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
----	---------------------------

	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	162,379,071.19	126,291,910.07
	业绩比较基准减少 5%	-162,379,071.19	-126,291,910.07

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,516,230,626.75	1,673,566,528.38
第二层次	1,824,705.43	2,536,024.55
第三层次	27,622,012.28	5,974,827.51
合计	2,545,677,344.46	1,682,077,380.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券等投资，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，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证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，确定相关证券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,538,845,231.59	85.42
	其中：股票	2,538,845,231.59	85.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,832,112.87	0.23
	其中：债券	6,832,112.87	0.23
	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	410,083,672.84	13.80
8	其他各项资产	16,356,420.58	0.55
9	合计	2,972,117,437.88	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,245,669.45	0.31
B	采矿业	10,824,243.66	0.37
C	制造业	1,353,429,004.54	45.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	772,144.09	0.03
E	建筑业	47,532,993.58	1.61
F	批发和零售业	12,230,956.57	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	37,553,850.37	1.27
H	住宿和餐饮业	148,942.32	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,111,987.72	1.73
J	金融业	390,683,366.55	13.25
K	房地产业	447,958,340.19	15.19
L	租赁和商务服务业	225,264.28	0.01
M	科学研究和技术服务业	139,321,920.33	4.73
N	水利、环境和公共设施管理业	963,570.99	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,409.10	0.00
Q	卫生和社会工作	36,621,573.80	1.24
R	文化、体育和娱乐业	212,994.05	0.01
S	综合	-	-
	合计	2,538,845,231.59	86.10

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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利发展	15,549,467	271,493,693.82	9.21
2	600519	贵州茅台	116,521	238,285,445.00	8.08
3	300750	宁德时代	274,329	146,491,686.00	4.97
4	002142	宁波银行	3,809,952	136,434,381.12	4.63
5	300059	东方财富	3,073,663	78,071,040.20	2.65
6	600926	杭州银行	5,133,560	76,900,728.80	2.61
7	603259	药明康德	732,143	76,135,550.57	2.58

8	002179	中航光电	1,116,730	70,711,343.60	2.40
9	600887	伊利股份	1,781,401	69,385,568.95	2.35
10	000002	万 科 A	2,706,334	55,479,847.00	1.88
11	601838	成都银行	2,589,600	42,935,568.00	1.46
12	300347	泰格医药	372,400	42,621,180.00	1.45
13	601668	中国建筑	7,978,435	42,445,274.20	1.44
14	603486	科沃斯	347,300	42,332,397.00	1.44
15	000799	酒鬼酒	222,574	41,356,474.94	1.40
16	300661	圣邦股份	227,077	40,403,287.54	1.37
17	603506	南都物业	2,506,100	34,985,156.00	1.19
18	002352	顺丰控股	610,000	34,044,100.00	1.15
19	600298	安琪酵母	690,200	33,647,250.00	1.14
20	688016	心脉医疗	156,010	30,392,308.10	1.03
21	300015	爱尔眼科	671,425	30,059,697.25	1.02
22	600557	康缘药业	2,006,600	29,476,954.00	1.00
23	688122	西部超导	308,391	28,433,650.20	0.96
24	603267	鸿远电子	198,700	26,691,371.00	0.91
25	000776	广发证券	1,356,615	25,368,700.50	0.86
26	002415	海康威视	681,991	24,688,074.20	0.84
27	601166	兴业银行	1,204,180	23,963,182.00	0.81
28	001979	招商蛇口	1,779,231	23,895,072.33	0.81
29	002371	北方华创	85,900	23,804,608.00	0.81
30	603456	九洲药业	458,600	23,709,620.00	0.80
31	002049	紫光国微	121,807	23,109,224.04	0.78
32	000999	华润三九	498,300	22,423,500.00	0.76
33	002968	新大正	859,844	21,203,753.04	0.72
34	688008	澜起科技	333,923	20,229,055.34	0.69
35	002756	永兴材料	128,200	19,513,322.00	0.66
36	300395	菲利华	430,650	19,379,250.00	0.66
37	002821	凯莱英	65,900	19,045,100.00	0.65
38	300627	华测导航	539,180	18,542,400.20	0.63
39	000733	振华科技	131,600	17,893,652.00	0.61
40	002430	杭氧股份	563,391	17,611,602.66	0.60
41	688668	鼎通科技	242,743	17,074,542.62	0.58
42	603986	兆易创新	117,400	16,695,454.00	0.57
43	603920	世运电路	956,600	16,549,180.00	0.56
44	300760	迈瑞医疗	52,742	16,518,794.40	0.56
45	002410	广联达	290,302	15,804,040.88	0.54
46	600383	金地集团	1,022,400	13,741,056.00	0.47
47	688200	华峰测控	37,741	13,450,892.40	0.46
48	688385	复旦微电	202,855	13,224,117.45	0.45
49	002555	三七互娱	565,300	12,001,319.00	0.41

50	300759	康龙化成	126,000	11,997,720.00	0.41
51	603290	斯达半导	30,800	11,885,720.00	0.40
52	000537	广宇发展	893,300	11,603,967.00	0.39
53	603444	吉比特	29,603	11,485,964.00	0.39
54	603678	火炬电子	241,600	11,309,296.00	0.38
55	603712	七一二	350,800	11,050,200.00	0.37
56	600809	山西汾酒	33,795	10,976,616.00	0.37
57	300034	钢研高纳	243,200	10,258,176.00	0.35
58	002271	东方雨虹	189,000	9,727,830.00	0.33
59	601899	紫金矿业	1,015,500	9,474,615.00	0.32
60	688636	智明达	83,130	9,426,110.70	0.32
61	600153	建发股份	708,300	9,257,481.00	0.31
62	000998	隆平高科	544,178	9,066,005.48	0.31
63	300363	博腾股份	114,450	8,925,955.50	0.30
64	002595	豪迈科技	383,300	8,562,922.00	0.29
65	002466	天齐锂业	67,400	8,411,520.00	0.29
66	000661	长春高新	34,400	8,029,648.00	0.27
67	600007	中国国贸	488,600	7,206,850.00	0.24
68	002812	恩捷股份	28,100	7,037,645.00	0.24
69	600919	江苏银行	965,300	6,872,936.00	0.23
70	600760	中航沈飞	113,000	6,830,850.00	0.23
71	002568	百润股份	218,957	6,577,468.28	0.22
72	002244	滨江集团	735,900	6,365,535.00	0.22
73	300012	华测检测	261,100	6,060,131.00	0.21
74	002409	雅克科技	104,600	5,806,346.00	0.20
75	300122	智飞生物	51,600	5,728,116.00	0.19
76	603501	韦尔股份	32,500	5,623,475.00	0.19
77	688220	翱捷科技	79,822	5,544,220.42	0.19
78	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.18
79	000568	泸州老窖	20,666	5,094,995.64	0.17
80	688116	天奈科技	28,765	4,875,092.20	0.17
81	688017	绿的谐波	37,611	4,475,709.00	0.15
82	600570	恒生电子	100,800	4,388,832.00	0.15
83	300274	阳光电源	43,500	4,273,875.00	0.14
84	601021	春秋航空	59,100	3,448,485.00	0.12
85	300474	景嘉微	45,600	3,118,584.00	0.11
86	002044	美年健康	543,400	3,026,738.00	0.10
87	300633	开立医疗	96,900	2,909,907.00	0.10
88	002025	航天电器	40,500	2,827,710.00	0.10
89	601669	中国电建	349,500	2,750,565.00	0.09
90	600422	昆药集团	224,400	2,726,460.00	0.09
91	688126	沪硅产业	114,570	2,632,818.60	0.09

92	600861	北京城乡	117,000	2,548,260.00	0.09
93	601238	广汽集团	161,100	2,455,164.00	0.08
94	603882	金域医学	28,400	2,344,420.00	0.08
95	601800	中国交建	248,900	2,309,792.00	0.08
96	688268	华特气体	30,072	2,112,858.72	0.07
97	301096	百诚医药	26,263	2,074,777.00	0.07
98	000656	金科股份	693,500	1,983,410.00	0.07
99	301050	雷电微力	18,720	1,901,203.20	0.06
100	688297	中无人机	37,246	1,708,846.48	0.06
101	300855	图南股份	37,500	1,567,125.00	0.05
102	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.05
103	600763	通策医疗	4,600	802,424.00	0.03
104	688331	荣昌生物	15,915	744,185.40	0.03
105	688072	拓荆科技	5,300	740,834.00	0.03
106	002594	比亚迪	2,200	733,678.00	0.02
107	600011	华能国际	98,600	694,144.00	0.02
108	688337	普源精电	6,563	381,179.04	0.01
109	301150	中一科技	4,026	365,898.42	0.01
110	301216	万凯新材	11,195	351,287.05	0.01
111	301109	军信股份	18,375	312,944.13	0.01
112	688119	中钢洛耐	33,327	293,944.14	0.01
113	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
114	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.01
115	688045	必易微	3,939	264,622.02	0.01
116	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
117	688306	均普智能	47,094	260,429.82	0.01
118	603129	春风动力	2,200	250,184.00	0.01
119	688325	赛微微电	4,039	247,186.80	0.01
120	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
121	301263	泰恩康	6,813	234,514.72	0.01
122	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.01
123	301102	兆讯传媒	6,414	211,821.06	0.01
124	688209	英集芯	6,822	208,753.20	0.01
125	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.01
126	301153	中科江南	3,973	196,933.29	0.01
127	301256	华融化学	18,308	196,408.08	0.01
128	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
129	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.01
130	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.01
131	301160	翔楼新材	3,918	166,768.58	0.01
132	301151	冠龙节能	7,025	161,883.22	0.01
133	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.01

134	301212	联盛化学	4,158	155,441.76	0.01
135	688290	景业智能	3,040	154,736.00	0.01
136	301248	杰创智能	4,716	153,047.20	0.01
137	688282	理工导航	3,185	152,784.45	0.01
138	301073	君亭酒店	2,148	148,942.32	0.01
139	688251	井松智能	3,392	141,853.44	0.00
140	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.00
141	301258	富士莱	2,942	132,548.81	0.00
142	301097	天益医疗	2,486	130,023.27	0.00
143	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.00
144	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
145	301237	和顺科技	2,610	116,160.66	0.00
146	301137	哈焊华通	6,431	111,743.67	0.00
147	688778	厦钨新能	994	110,801.18	0.00
148	300896	爱美客	184	110,401.84	0.00
149	605499	东鹏饮料	632	107,983.52	0.00
150	688662	富信科技	2,556	104,923.80	0.00
151	301163	宏德股份	2,764	101,994.08	0.00
152	301155	海力风电	1,119	101,829.00	0.00
153	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.00
154	688676	金盘科技	3,750	97,500.00	0.00
155	601825	沪农商行	15,480	97,059.60	0.00
156	688359	三孚新科	2,213	93,277.95	0.00
157	301048	金鹰重工	8,424	92,748.24	0.00
158	688070	纵横股份	2,407	92,693.57	0.00
159	300967	晓鸣股份	5,061	91,148.61	0.00
160	688737	中自科技	2,186	90,347.38	0.00
161	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.00
162	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.00
163	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.00
164	301021	英诺激光	2,899	87,549.80	0.00
165	688661	和林微纳	1,452	87,061.92	0.00
166	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.00
167	300919	中伟股份	693	85,862.70	0.00
168	688793	倍轻松	1,454	85,800.54	0.00
169	301013	利和兴	7,056	84,601.44	0.00
170	688509	正元地信	15,433	83,183.87	0.00
171	301052	果麦文化	2,520	82,983.60	0.00
172	688611	杭州柯林	1,400	82,292.00	0.00
173	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.00
174	688628	优利德	2,789	81,968.71	0.00
175	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.00

176	688103	国力股份	1,595	81,536.40	0.00
177	301193	家联科技	2,970	80,635.50	0.00
178	688236	春立医疗	4,052	80,229.60	0.00
179	301133	金钟股份	2,860	79,422.20	0.00
180	301028	东亚机械	7,329	79,299.78	0.00
181	688683	莱尔科技	3,296	79,235.84	0.00
182	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.00
183	300978	东箭科技	5,930	77,386.50	0.00
184	301045	天禄科技	3,350	77,284.50	0.00
185	301198	喜悦智行	3,397	76,602.35	0.00
186	688283	坤恒顺维	1,595	76,033.65	0.00
187	301026	浩通科技	2,027	74,755.76	0.00
188	603529	爱玛科技	1,427	74,746.26	0.00
189	688195	腾景科技	2,693	74,649.96	0.00
190	301279	金道科技	2,956	73,863.56	0.00
191	301004	嘉益股份	3,115	73,700.90	0.00
192	688187	时代电气	1,131	73,503.69	0.00
193	301040	中环海陆	2,401	73,302.53	0.00
194	688633	星球石墨	1,558	72,478.16	0.00
195	301038	深水规院	3,458	71,891.82	0.00
196	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.00
197	301027	华蓝集团	2,856	69,343.68	0.00
198	300979	华利集团	946	69,133.68	0.00
199	301035	润丰股份	838	69,093.10	0.00
200	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.00
201	301066	万事利	4,810	68,590.60	0.00
202	688768	容知日新	907	68,551.06	0.00
203	688210	统联精密	3,105	67,285.35	0.00
204	688171	纬德信息	2,821	66,152.45	0.00
205	688526	科前生物	2,533	65,832.67	0.00
206	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
207	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
208	301002	崧盛股份	2,601	64,686.87	0.00
209	688113	联测科技	1,415	64,453.25	0.00
210	688319	欧林生物	3,412	64,452.68	0.00
211	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
212	688131	皓元医药	445	63,230.05	0.00
213	301055	张小泉	3,541	62,958.98	0.00
214	688739	成大生物	1,223	62,140.63	0.00
215	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.00
216	688799	华纳药厂	1,917	61,631.55	0.00
217	301081	严牌股份	4,024	60,681.92	0.00

218	300998	宁波方正	2,003	60,590.75	0.00
219	300814	中富电路	3,280	60,024.00	0.00
220	300943	春晖智控	3,813	59,902.23	0.00
221	688329	艾隆科技	1,846	59,718.10	0.00
222	688571	杭华股份	8,200	59,696.00	0.00
223	688690	纳微科技	736	59,476.16	0.00
224	300991	创益通	4,056	58,325.28	0.00
225	301083	百胜智能	4,160	58,073.60	0.00
226	688355	明志科技	2,710	58,021.10	0.00
227	688216	气派科技	2,000	57,720.00	0.00
228	301072	中捷精工	1,802	57,718.06	0.00
229	301011	华立科技	1,750	57,557.50	0.00
230	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.00
231	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.00
232	301177	迪阿股份	762	56,540.40	0.00
233	300861	美畅股份	609	56,448.21	0.00
234	301030	仕净科技	2,417	56,364.44	0.00
235	688601	力芯微	374	56,100.00	0.00
236	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.00
237	300972	万辰生物	4,300	55,599.00	0.00
238	688718	唯赛勃	3,145	55,414.90	0.00
239	301010	晶雪节能	2,172	55,060.20	0.00
240	300963	中洲特材	2,830	54,845.40	0.00
241	301206	三元生物	1,188	54,702.54	0.00
242	688339	亿华通	554	54,502.52	0.00
243	688191	智洋创新	3,203	54,451.00	0.00
244	301025	读客文化	4,027	53,075.86	0.00
245	301057	汇隆新材	2,173	52,912.55	0.00
246	688776	国光电气	310	52,696.90	0.00
247	688314	康拓医疗	1,085	52,676.75	0.00
248	002343	慈文传媒	9,241	52,396.47	0.00
249	688733	壹石通	709	52,033.51	0.00
250	688316	青云科技	1,428	51,493.68	0.00
251	300948	冠中生态	3,230	51,260.10	0.00
252	301016	雷尔伟	2,747	51,231.55	0.00
253	688276	百克生物	772	51,222.20	0.00
254	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.00
255	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.00
256	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
257	688700	东威科技	597	49,753.98	0.00
258	301056	森赫股份	5,716	49,500.56	0.00
259	688117	圣诺生物	1,672	48,571.60	0.00

260	688607	康众医疗	1,890	48,535.20	0.00
261	688468	科美诊断	3,919	48,321.27	0.00
262	688260	昀冢科技	2,990	48,079.20	0.00
263	301032	新柴股份	5,124	47,653.20	0.00
264	301049	超越科技	1,954	46,329.34	0.00
265	301036	双乐股份	2,047	46,016.56	0.00
266	688350	富淼科技	2,552	45,910.48	0.00
267	301007	德迈仕	3,022	45,541.54	0.00
268	688111	金山办公	230	45,337.60	0.00
269	301033	迈普医学	1,076	45,310.36	0.00
270	688789	宏华数科	274	45,108.62	0.00
271	688630	芯碁微装	694	44,901.80	0.00
272	300960	通业科技	2,332	43,655.04	0.00
273	301059	金三江	2,581	43,360.80	0.00
274	300992	泰福泵业	1,998	42,577.38	0.00
275	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.00
276	301041	金百泽	2,150	42,376.50	0.00
277	688217	睿昂基因	1,040	42,234.40	0.00
278	301029	怡合达	517	42,135.50	0.00
279	300887	谱尼测试	965	41,215.15	0.00
280	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.00
281	688580	伟思医疗	631	41,078.10	0.00
282	300995	奇德新材	1,909	40,852.60	0.00
283	300973	立高食品	393	40,852.35	0.00
284	300854	中兰环保	2,026	40,276.88	0.00
285	688800	瑞可达	316	39,913.96	0.00
286	688655	迅捷兴	3,083	39,585.72	0.00
287	600916	中国黄金	3,371	39,440.70	0.00
288	688269	凯立新材	371	39,326.00	0.00
289	688658	悦康药业	2,085	39,239.70	0.00
290	688328	深科达	1,499	37,699.85	0.00
291	300957	贝泰妮	173	37,632.69	0.00
292	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.00
293	301089	拓新药业	298	37,434.76	0.00
294	688390	固德威	119	37,248.19	0.00
295	300911	亿田智能	483	37,118.55	0.00
296	688308	欧科亿	557	37,073.92	0.00
297	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
298	688665	四方光电	248	36,704.00	0.00
299	688699	明微电子	333	36,117.18	0.00
300	301053	远信工业	1,544	36,067.84	0.00
301	688659	元琛科技	3,671	34,764.37	0.00

302	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.00
303	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.00
304	688367	工大高科	1,717	34,391.51	0.00
305	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.00
306	688517	金冠电气	2,892	33,662.88	0.00
307	688211	中科微至	824	33,561.52	0.00
308	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.00
309	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.00
310	688779	长远锂科	1,669	33,380.00	0.00
311	688087	英科再生	563	32,580.81	0.00
312	688667	菱电电控	224	32,352.32	0.00
313	688161	威高骨科	669	32,239.11	0.00
314	688621	阳光诺和	294	32,163.60	0.00
315	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
316	001201	东瑞股份	802	30,941.16	0.00
317	605090	九丰能源	1,526	30,932.02	0.00
318	688766	普冉股份	189	30,831.57	0.00
319	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
320	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.00
321	688023	安恒信息	198	29,236.68	0.00
322	300894	火星人	779	29,126.81	0.00
323	688677	海泰新光	306	28,148.94	0.00
324	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
325	688190	云路股份	361	28,067.75	0.00
326	688701	卓锦股份	2,340	27,658.80	0.00
327	301069	凯盛新材	586	27,020.46	0.00
328	688097	博众精工	783	26,661.15	0.00
329	688538	和辉光电	9,834	26,355.12	0.00
330	300900	广联航空	982	26,219.40	0.00
331	688067	爱威科技	1,259	26,212.38	0.00
332	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
333	688059	华锐精密	185	25,526.30	0.00
334	301058	中粮工科	1,460	25,389.40	0.00
335	688681	科汇股份	1,899	25,313.67	0.00
336	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
337	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
338	688221	前沿生物	1,685	24,988.55	0.00
339	003039	顺控发展	1,024	24,729.60	0.00
340	601921	浙版传媒	3,154	24,538.12	0.00
341	688560	明冠新材	714	24,447.36	0.00
342	688626	翔宇医疗	731	24,313.06	0.00
343	300873	海晨股份	853	24,114.31	0.00

344	605080	浙江自然	374	23,894.86	0.00
345	688093	世华科技	1,231	23,782.92	0.00
346	688079	美迪凯	2,086	23,530.08	0.00
347	301060	兰卫医学	669	23,428.38	0.00
348	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.00
349	301039	中集车辆	2,140	23,176.20	0.00
350	688686	奥普特	89	23,019.85	0.00
351	003040	楚天龙	1,101	22,636.56	0.00
352	688005	容百科技	172	22,263.68	0.00
353	688788	科思科技	487	22,017.27	0.00
354	688663	新风光	648	22,012.56	0.00
355	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.00
356	688425	铁建重工	5,338	21,725.66	0.00
357	300872	天阳科技	1,623	21,634.59	0.00
358	688335	复洁环保	745	21,388.95	0.00
359	688257	新锐股份	538	21,315.56	0.00
360	688678	福立旺	840	21,310.80	0.00
361	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
362	003028	振邦智能	432	21,107.52	0.00
363	688085	三友医疗	957	20,719.05	0.00
364	300890	翔丰华	354	19,583.28	0.00
365	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
366	301166	优宁维	328	19,306.08	0.00
367	688698	伟创电气	947	19,271.45	0.00
368	688083	中望软件	92	19,266.64	0.00
369	605077	华康股份	865	19,073.25	0.00
370	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
371	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
372	301221	光庭信息	291	18,865.53	0.00
373	300941	创识科技	884	18,608.20	0.00
374	300925	法本信息	1,525	18,223.75	0.00
375	688696	极米科技	59	18,164.33	0.00
376	301189	奥尼电子	545	18,153.95	0.00
377	605268	王力安防	1,642	18,012.74	0.00
378	688499	利元亨	81	17,925.30	0.00
379	603171	税友股份	637	17,823.26	0.00
380	300982	苏文电能	370	17,375.20	0.00
381	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
382	300878	维康药业	731	17,112.71	0.00
383	300864	南大环境	811	17,031.00	0.00
384	002928	华夏航空	1,435	16,889.95	0.00
385	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00

386	300913	兆龙互连	1,050	16,663.50	0.00
387	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
388	301093	华兰股份	488	16,538.32	0.00
389	300994	久祺股份	495	16,240.95	0.00
390	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
391	300893	松原股份	801	16,180.20	0.00
392	605060	联德股份	883	16,026.45	0.00
393	300932	三友联众	865	15,907.35	0.00
394	688313	仕佳光子	1,392	15,868.80	0.00
395	688619	罗普特	1,144	15,787.20	0.00
396	688133	泰坦科技	88	15,544.32	0.00
397	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
398	301190	善水科技	641	15,210.93	0.00
399	001216	华瓷股份	1,178	15,137.30	0.00
400	300930	屹通新材	420	15,086.40	0.00
401	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
402	300891	惠云钛业	1,225	14,785.75	0.00
403	301100	风光股份	685	14,782.30	0.00
404	301118	恒光股份	342	14,716.26	0.00
405	605169	洪通燃气	1,292	14,547.92	0.00
406	003029	吉大正元	716	14,534.80	0.00
407	688613	奥精医疗	467	14,448.98	0.00
408	605277	新亚电子	705	14,431.35	0.00
409	605133	嵘泰股份	618	14,139.84	0.00
410	300937	药易购	434	13,896.68	0.00
411	300940	南极光	589	13,859.17	0.00
412	301138	华研精机	449	13,806.75	0.00
413	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
414	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
415	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.00
416	688669	聚石化学	523	13,404.49	0.00
417	002997	瑞鹤模具	751	13,202.58	0.00
418	300879	大叶股份	560	13,081.60	0.00
419	300908	仲景食品	347	13,057.61	0.00
420	300884	狄耐克	1,229	12,707.86	0.00
421	300895	铜牛信息	434	12,594.68	0.00
422	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
423	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
424	300942	易瑞生物	528	12,196.80	0.00
425	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
426	301017	漱玉平民	650	12,051.00	0.00
427	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00

428	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.00
429	688819	天能股份	343	11,860.94	0.00
430	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
431	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
432	301188	力诺特玻	647	11,516.60	0.00
433	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
434	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
435	688777	中控技术	155	11,277.80	0.00
436	300868	杰美特	625	11,175.00	0.00
437	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
438	300968	格林精密	1,220	11,053.20	0.00
439	003031	中瓷电子	171	11,046.60	0.00
440	605005	合兴股份	634	10,993.56	0.00
441	300907	康平科技	524	10,831.08	0.00
442	688556	高测股份	134	10,813.80	0.00
443	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
444	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
445	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
446	301111	粤万年青	383	10,501.86	0.00
447	300454	深信服	100	10,378.00	0.00
448	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
449	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
450	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
451	300933	中辰股份	1,217	9,918.55	0.00
452	003042	中农联合	546	9,789.78	0.00
453	300877	金春股份	586	9,704.16	0.00
454	300614	百川畅银	383	9,636.28	0.00
455	300918	南山智尚	1,126	9,627.30	0.00
456	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
457	605228	神通科技	1,217	9,407.41	0.00
458	300892	品渥食品	314	9,404.30	0.00
459	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
460	300639	凯普生物	435	9,300.30	0.00
461	688618	三旺通信	219	9,272.46	0.00
462	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.00
463	300882	万胜智能	642	9,142.08	0.00
464	300922	天秦装备	508	9,123.68	0.00
465	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
466	300926	博俊科技	384	8,966.40	0.00
467	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
468	300876	蒙泰高新	395	8,844.05	0.00
469	605180	华生科技	499	8,677.61	0.00

470	300952	恒辉安防	498	8,665.20	0.00
471	688065	凯赛生物	77	8,608.60	0.00
472	300945	曼卡龙	531	8,538.48	0.00
473	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.00
474	003032	传智教育	586	8,409.10	0.00
475	003036	泰坦股份	776	8,310.96	0.00
476	300927	江天化学	473	8,182.90	0.00
477	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
478	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
479	300999	金龙鱼	149	8,048.98	0.00
480	688356	键凯科技	33	7,979.73	0.00
481	688109	品茗股份	254	7,848.60	0.00
482	001210	金房节能	311	7,790.55	0.00
483	300958	建工修复	393	7,773.54	0.00
484	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
485	688608	恒玄科技	56	7,705.60	0.00
486	300961	深水海纳	536	7,268.16	0.00
487	688386	泛亚微透	133	7,220.57	0.00
488	300881	盛德鑫泰	306	6,995.16	0.00
489	300950	德固特	429	6,992.70	0.00
490	300889	爱克股份	486	6,940.08	0.00
491	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
492	300975	商络电子	775	6,796.75	0.00
493	688317	之江生物	181	6,767.59	0.00
494	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.00
495	300987	川网传媒	395	6,663.65	0.00
496	300886	华业香料	213	6,620.04	0.00
497	688578	艾力斯	304	6,414.40	0.00
498	003004	声迅股份	306	6,383.16	0.00
499	300931	通用电梯	813	6,284.49	0.00
500	003009	中天火箭	123	5,755.17	0.00
501	688679	通源环境	497	5,397.42	0.00
502	688529	豪森股份	170	5,215.60	0.00
503	300929	华骐环保	363	4,991.25	0.00
504	688311	盟升电子	82	4,956.08	0.00
505	300142	沃森生物	100	4,839.00	0.00
506	603155	新亚强	126	4,694.76	0.00
507	688408	中信博	50	4,624.00	0.00
508	688136	科兴制药	171	4,531.50	0.00
509	688330	宏力达	51	4,385.49	0.00
510	300815	玉禾田	240	4,173.60	0.00
511	688521	芯原股份	80	3,952.00	0.00

512	300866	安克创新	59	3,912.88	0.00
513	688510	航亚科技	196	3,755.36	0.00
514	688281	华秦科技	14	3,682.00	0.00
515	688660	电气风电	359	3,399.73	0.00
516	000906	浙商中拓	300	2,724.00	0.00
517	300858	科拓生物	92	2,451.80	0.00
518	600030	中信证券	105	2,274.30	0.00
519	300087	荃银高科	120	1,975.20	0.00
520	688590	新致软件	135	1,934.55	0.00
521	688557	兰剑智能	60	1,930.20	0.00
522	300903	科翔股份	135	1,904.85	0.00
523	605016	百龙创园	45	1,890.90	0.00
524	688096	京源环保	129	1,749.24	0.00
525	688559	海目星	24	1,744.80	0.00
526	688229	博睿数据	43	1,741.50	0.00
527	688160	步科股份	60	1,675.20	0.00
528	605333	沪光股份	70	1,617.00	0.00
529	688519	南亚新材	56	1,586.48	0.00
530	688057	金达莱	84	1,553.16	0.00
531	300837	浙矿股份	37	1,500.35	0.00
532	688256	寒武纪	23	1,488.10	0.00
533	688197	首药控股	60	1,480.80	0.00
534	605100	华丰股份	95	1,372.75	0.00
535	688338	赛科希德	41	1,370.22	0.00
536	003027	同兴环保	73	1,273.85	0.00
537	605377	华旺科技	70	1,253.70	0.00
538	300862	蓝盾光电	43	1,164.44	0.00
539	605116	奥锐特	42	918.96	0.00
540	688112	鼎阳科技	15	917.10	0.00
541	688215	瑞晟智能	29	882.47	0.00
542	688513	苑东生物	17	841.84	0.00
543	688379	华光新材	50	810.50	0.00
544	605183	确成股份	41	791.30	0.00
545	688569	铁科轨道	41	752.35	0.00
546	300880	迦南智能	46	677.58	0.00
547	688378	奥来德	15	585.15	0.00
548	688151	华强科技	23	549.01	0.00
549	688596	正帆科技	27	535.14	0.00
550	003003	天元股份	56	512.40	0.00
551	688127	蓝特光学	22	494.12	0.00
552	688551	科威尔	11	433.62	0.00
553	300846	首都在线	31	419.12	0.00

554	688056	莱伯泰科	10	367.00	0.00
555	000977	浪潮信息	12	317.76	0.00
556	688155	先惠技术	3	312.60	0.00
557	003035	南网能源	46	292.10	0.00
558	300865	大宏立	11	236.50	0.00
559	688585	上纬新材	22	212.52	0.00
560	688055	龙腾光电	28	150.92	0.00
561	688577	浙海德曼	3	123.18	0.00
562	300883	龙利得	11	76.01	0.00
563	300920	润阳科技	3	64.08	0.00
564	688156	路德环境	2	42.66	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	185,597,229.05	9.48
2	600048	保利发展	169,468,070.08	8.66
3	300750	宁德时代	78,888,475.00	4.03
4	001979	招商蛇口	74,393,677.26	3.80
5	000799	酒鬼酒	66,246,241.89	3.38
6	002142	宁波银行	58,792,758.42	3.00
7	300347	泰格医药	57,836,887.32	2.95
8	601166	兴业银行	55,762,965.60	2.85
9	600887	伊利股份	50,858,759.27	2.60
10	600926	杭州银行	47,068,031.00	2.40
11	000002	万科 A	41,172,739.50	2.10
12	603486	科沃斯	38,258,231.33	1.95
13	600298	安琪酵母	36,782,253.50	1.88
14	002244	滨江集团	36,251,892.90	1.85
15	300059	东方财富	35,752,224.74	1.83
16	603506	南都物业	35,407,376.82	1.81
17	002352	顺丰控股	34,473,142.00	1.76
18	000656	金科股份	33,568,735.00	1.72
19	600809	山西汾酒	33,035,227.91	1.69
20	300661	圣邦股份	32,761,793.60	1.67

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002244	滨江集团	111,563,535.70	5.70
2	600048	保利发展	94,927,793.98	4.85
3	001979	招商蛇口	75,171,499.15	3.84
4	603259	药明康德	53,381,241.54	2.73
5	300661	圣邦股份	41,189,570.00	2.10
6	300917	特发服务	36,861,609.61	1.88
7	000656	金科股份	35,721,843.12	1.83
8	300347	泰格医药	35,437,178.00	1.81
9	000799	酒鬼酒	34,404,622.80	1.76
10	601668	中国建筑	32,978,027.00	1.68
11	000002	万科 A	29,416,850.46	1.50
12	601166	兴业银行	28,762,264.00	1.47
13	688202	美迪西	27,883,016.45	1.42
14	600809	山西汾酒	27,286,937.02	1.39
15	600905	三峡能源	24,528,698.00	1.25
16	300059	东方财富	23,327,752.13	1.19
17	300627	华测导航	20,956,179.50	1.07
18	603345	安井食品	20,899,325.25	1.07
19	002603	以岭药业	20,792,931.80	1.06
20	300750	宁德时代	20,308,391.80	1.04

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,210,720,809.63
卖出股票收入（成交）总额	1,334,517,533.15

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	6,832,112.87	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,832,112.87	0.23

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

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113055	成银转债	46,510	6,116,186.05	0.21
2	127064	杭氧转债	6,513	651,422.77	0.02
3	113633	科沃转债	530	62,921.63	0.00
4	123117	健帆转债	13	1,460.14	0.00
5	123064	万孚转债	1	122.28	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	559,272.79
2	应收清算款	13,105,860.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,691,287.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,356,420.58

7.12.4 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	113633	科沃转债	62,921.63	0.00
2	123117	健帆转债	1,460.14	0.00
3	123064	万孚转债	122.28	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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
工银美丽城镇股票	239,295	3,461.03	565,811,534.62	68.32	262,395,662.22	31.68

A						
工银美丽城镇股票 C	13,866	17,567.64	221,872,414.85	91.08	21,720,472.31	8.92
合计	253,161	4,233.67	787,683,949.47	73.49	284,116,134.53	26.51

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	工银美丽城镇股票 A	967,820.20	0.12
	工银美丽城镇股票 C	38,576.70	0.02
	合计	1,006,396.90	0.09

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	工银美丽城镇股票 A	50~100
	工银美丽城镇股票 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	工银美丽城镇股票 A	50~100
	工银美丽城镇股票 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
基金合同生效日（2015年3月26日）基金份额总额	2,380,276,036.62	-
本报告期期初基金份额总额	626,409,142.27	56,120,841.41
本报告期基金总申购份额	385,785,314.66	261,664,222.81
减：本报告期基金总赎回份额	183,987,260.09	74,192,177.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	828,207,196.84	243,592,887.16
-------------	----------------	----------------

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	1	1,526,416,967.06	43.41	935,709.08	41.82	-
长江证券	1	816,505,113.67	23.22	499,544.12	22.33	-
天风证券	2	747,800,125.36	21.27	535,097.10	23.91	-
中信证券	1	224,000,171	6.37	139,169.97	6.22	-

		. 36				
国金证券	1	152, 418, 260 . 41	4. 34	93, 239. 92	4. 17	-
长城证券	2	48, 847, 239. 55	1. 39	34, 746. 87	1. 55	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	302,370.97	100.00	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 1 月 1 日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于在直销电子自助交易系统开展货币市场基金赎回转申购及赎回转认购费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 3 月 11 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 4 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日