

工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	52
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	67
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	68
§ 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	71
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	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金	
基金简称	工银中证 500 六个月持有指数增强	
基金主代码	014133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 14 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	326,876,847.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014133	014134
报告期末下属分级基金的份额总额	209,522,421.31 份	117,354,426.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，长期来看，本基金具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金如果投资港股通投资标的股票，还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国民生银行股份有限公司
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
		罗菲菲
		010-58560666
		tgxxpl@cmbc.com.cn

客户服务电话	400-811-9999	95568
传真	010-66583158	010-57093382
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	赵桂才	高迎欣

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)	
	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
本期已实现收益	-24,753,624.26	-14,553,938.79
本期利润	-20,486,286.56	-12,036,551.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0918	-0.0937
本期加权平均净值利润率	-10.46%	-10.69%
本期基金份额净值增长率	-9.00%	-9.18%
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	-23,520,683.55	-13,394,329.20

期末可供分配基金份额利润	-0.1123	-0.1141
期末基金资产净值	192,041,333.47	107,329,622.35
期末基金份额净值	0.9166	0.9146
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	-8.34%	-8.54%

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

工银中证 500 六个月持有指数增强 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	8.72%	1.10%	6.74%	1.05%	1.98%	0.05%
过去三个月	5.56%	1.63%	1.99%	1.66%	3.57%	-0.03%
过去六个月	-9.00%	1.51%	-11.65%	1.55%	2.65%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-8.34%	1.43%	-11.57%	1.48%	3.23%	-0.05%

工银中证 500 六个月持有指数增强 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	8.69%	1.10%	6.74%	1.05%	1.95%	0.05%
过去三个月	5.47%	1.63%	1.99%	1.66%	3.48%	-0.03%
过去六个月	-9.18%	1.51%	-11.65%	1.55%	2.47%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-8.54%	1.43%	-11.57%	1.48%	3.03%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

工银中证500六个月持有指数增强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



工银中证500六个月持有指数增强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 2021 年 12 月 14 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效未满 1 年。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是由中国工商银行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		
刘伟琳	指数投资中心投资副总监、本基金的基金经理	2021 年 12 月 14 日	-	12 年	博士；2010 年加入工银瑞信，现任指数投资中心投资副总监、基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金(自 2018 年 4 月 17 日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF))基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至 2022 年 3 月 21 日，担任工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金(自 2020 年 2 月 18 日起变更为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金)基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金(自 2020 年 11 月 26 日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金(LOF))基金经理；2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日，担任工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理；2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金经理；2018 年 6 月 15 日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金(LOF)基金经理；2019 年 5 月 20 日至今，担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 8 月 21 日至今，担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数

					<p>证券投资基金联接基金基金经理；2019 年 10 月 17 日至 2022 年 3 月 21 日，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 1 日至 2022 年 3 月 21 日，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 25 日至 2022 年 3 月 21 日，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 21 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 22 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 6 月 11 日至今，担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 22 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2021 年 8 月 5 日至今，担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 11 月 26 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2021 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理；2022 年 6 月 30 日至今，担任工银瑞信国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 7 月 4 日至今，担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
邓皓友	本基金的基金经理	2021 年 12 月 14 日	-	8 年	<p>曾在瀚华金控股份有限公司担任数据分析师；2014 年加入工银瑞信，现任指数投资中心衍生品投资资深研究员、基金经理。2019 年 10 月 29 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 29 日至今，担任工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证消费服务</p>

					<p>领先交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 24 日至今，担任工银瑞信大和日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 180ESG 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所

公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 6 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，市场受到了多个超预期事件的影响，整体一直处于波动之中。年初在稳增长政策的带动下，市场风格更偏向于价值，俄乌冲突的爆发，又为稳增长带来了不小的压力；二季度在疫情的超预期扰动下，产业链受到了较大的影响，基本面也同样受到了较大的冲击，部分新兴产业更是如此。进入 5 月份后，随着美联储加息缩表节奏的逐渐清晰，市场风险偏好出现了较大变化，成长风格再次主导，在疫后复产复工的带动下，国内经济重新回到逐步复苏的进程中。从整体来看，市场在 2022 年上半年，先经历了较大幅度的跌幅，下跌的幅度和速度都超出了市场的预期，5 月之后，市场出现了较大的反弹，尤其对于前期受到压制的成长型行业，市场此前较为悲观的预期出现了一些积极的变化。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，对于风格和行业进行较为严格的暴露控制，在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上，力争获取更高的超额收益。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，力争增厚收益。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

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-9.00%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为-11.65%，本基金 C 份额净值增长率为-9.18%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内稳增长形势依然严峻，稳增长的效果将决定经济复苏的进程。在地产温和改善、信用扩张幅度有限的基准情形下，市场或更多基于短期景气度进行投资，但考虑到通胀读数上行、货币难以进一步宽松，市场较难出现全面上涨态势。受益于稳增长政策的消费领域在经历过较为充分的风险释放之后，也有望确认底部区域并形成结构性行情，新兴产业中热点赛道或继续保持较好的景气度，但可能存在一定程度的分化。下半年海外因素对于市场也将形成一定程度的制约，一方面是美联储加息缩表的进程对于全球资产的影响可能进一步加深，另一方面，美股如果出现系统性风险，对于新兴市场既有负面冲击但也存在一定机会。总的来看，我们认为下半年权益市场仍然会以波动为主，景气度相对较高和投资性价比相对较高的板块更容易得到市场的关注和配置。

本基金为指数增强型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，在力求对标的指数进行

有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报。

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金

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	19,122,874.03	33,391,005.01
结算备付金		10,277.36	6,878,421.62
存出保证金		-	2,250,186.40
交易性金融资产	6.4.7.2	281,601,094.85	310,230,318.41
其中：股票投资		281,531,060.67	310,230,318.41
基金投资		-	-
债券投资		70,034.18	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		35,300.13	22,058.33

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	51,551.64
资产总计		300,769,546.37	352,823,541.41
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		-	-
应付赎回款		967,633.83	-
应付管理人报酬		249,521.77	162,303.59
应付托管费		24,952.17	16,230.35
应付销售服务费		36,266.21	23,725.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		35,451.51	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	84,765.06	-
负债合计		1,398,590.55	202,259.90
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	326,876,847.55	350,106,941.96
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-27,505,891.73	2,514,339.55
净资产合计		299,370,955.82	352,621,281.51
负债和净资产总计		300,769,546.37	352,823,541.41

注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 14 日。

2、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额为 326,876,847.55 份，其中工银中证 500 六个月持有指数增强 A 基金份额总额为 209,522,421.31 份，基金份额净值 0.9166 元；工银中证 500 六个月持有指数增强 C 基金份额总额为 117,354,426.24 份，基金份额净值 0.9146 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，下同。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		-30,526,703.84
1. 利息收入		198,625.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	198,625.68
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-37,510,054.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-41,435,035.01
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	40,428.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	1,050,480.85
股利收益	6.4.7.19	2,834,070.42
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	6,784,725.46
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	-
减：二、营业总支出		1,996,133.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,530,877.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	153,087.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	223,583.43
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		3,798.56
8. 其他费用	6.4.7.23	84,786.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,522,837.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,522,837.59
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-32,522,837.59

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金

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）	350,106,941.96	-	2,514,339.55	352,621,281.51
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）	350,106,941.96	-	2,514,339.55	352,621,281.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,230,094.41	-	-30,020,231.28	-53,250,325.69
（一）、综合收益总额	-	-	-32,522,837.59	-32,522,837.59
（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）	-23,230,094.41	-	2,502,606.31	-20,727,488.10
其中：1. 基金申购款	6,958,621.14	-	-879,828.05	6,078,793.09
2. 基金赎回款	-30,188,715.55	-	3,382,434.36	-26,806,281.19

(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）	326,876,847.55	-	-27,505,891.73	299,370,955.82

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>郝焱</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

工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金（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[2021]3381 号《关于准予工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金注册的批复》的注册，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于 2021 年 11 月 24 日至 2021 年 12 月 10 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2021）验字第 60802052_A03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 12 月 14 日正式生效，设立时募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币 349,989,958.40 元，折合 349,989,958.40 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 94,811.21 元，折合 94,811.21 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 350,084,769.61 元，折合 350,084,769.61 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 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) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息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，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，具体收益分配安排详见基金管理人届时公告；

(2) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得基金份额将合并至参与分红的份额中，其最短持有期起始日与原份额最短持有期起始日相同，如有多笔份额明细参与分红，则红利再投资份额按比例分摊至各笔明细；

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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》的规定和相关法律法规的要求，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 33,391,005.01 元、6,878,421.62 元、2,250,186.40 元、0.00 元、0.00 元、51,551.64 元、0.00 元、22,058.33 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 33,421,895.91 元、6,899,082.36 元、2,250,186.40 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、22,058.33 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 310,230,318.41 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 310,230,318.41 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、0.00 元、0.00 元、162,303.59 元、16,230.35 元、23,725.96 元、0.00 元、0.00 元、0.00 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、0.00 元、0.00 元、162,303.59 元、16,230.35 元、23,725.96 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	4,228,214.53
等于：本金	4,227,951.07
加：应计利息	263.46
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	14,894,659.50
等于：本金	14,888,199.18
加：应计利息	6,460.32
减：坏账准备	-
合计	19,122,874.03

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		270,898,189.62	-	281,531,060.67	10,632,871.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	69,800.00	10.14	70,034.18	224.04
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	69,800.00	10.14	70,034.18	224.04
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		270,967,989.62	10.14	281,601,094.85	10,633,095.09

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
其他	462.50
合计	84,765.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银中证 500 六个月持有指数增强 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	222,151,830.80	222,151,830.80
本期申购	3,459,519.84	3,459,519.84
本期赎回（以“-”号填列）	-16,088,929.33	-16,088,929.33
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	209,522,421.31	209,522,421.31

工银中证 500 六个月持有指数增强 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	127,955,111.16	127,955,111.16
本期申购	3,499,101.30	3,499,101.30
本期赎回（以“-”号填列）	-14,099,786.22	-14,099,786.22
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	117,354,426.24	117,354,426.24

注：1、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。

2、本基金合同于 2021 年 12 月 14 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 350,084,769.61 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,811.21 份基金份额。

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

工银中证 500 六个月持有指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-831,503.25	2,442,143.66	1,610,640.41
本期利润	-24,753,624.26	4,267,337.70	-20,486,286.56
本期基金份额交易产生的变动数	2,064,443.96	-669,885.65	1,394,558.31
其中：基金申购款	-275,844.52	-126,610.20	-402,454.72
基金赎回款	2,340,288.48	-543,275.45	1,797,013.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,520,683.55	6,039,595.71	-17,481,087.84

工银中证 500 六个月持有指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-502,596.89	1,406,296.03	903,699.14
本期利润	-14,553,938.79	2,517,387.76	-12,036,551.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,662,206.48	-554,158.48	1,108,048.00
其中：基金申购款	-391,483.65	-85,889.68	-477,373.33
基金赎回款	2,053,690.13	-468,268.80	1,585,421.33

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,394,329.20	3,369,525.31	-10,024,803.89

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		3,386.14
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		174,459.74
结算备付金利息收入		20,779.80
其他		-
合计		198,625.68

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		-41,435,035.01
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		-41,435,035.01

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		1,863,135,072.84
减：卖出股票成本总额		1,899,065,745.86
减：交易费用		5,504,361.99
买卖股票差价收入		-41,435,035.01

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	43.67
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	40,385.09
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	40,428.76

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	199,622.33
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	159,200.00
减：应计利息总额	35.38
减：交易费用	1.86
买卖债券差价收入	40,385.09

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,050,480.85

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	2,834,070.42
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	2,834,070.42

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	6,899,591.46
股票投资	6,899,367.42
债券投资	224.04
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-114,866.00
权证投资	-
期货投资	-114,866.00
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	6,784,725.46

6.4.7.21 其他收入

无。

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	482.84
存托服务费	1.17
合计	84,786.57

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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
中国民生银行股份有限公司	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,530,877.44
其中：支付销售机构的客户维护费	491,863.07

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	153,087.75

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	2,572.61	2,572.61
中国工商银行股份有限公司	-	16,314.40	16,314.40
中国民生银行股份有限公司	-	865.62	865.62
合计	-	19,752.63	19,752.63

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 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	4,228,214.53	3,386.14

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
688320	禾川科技	2022年4月21日	6个月	新股锁定	23.66	46.21	6,048	143,095.68	279,478.08	-
688072	拓荆科技	2022年4月12日	6个月	新股锁定	71.88	139.78	1,908	137,147.04	266,700.24	-
688349	三一重能	2022年6月15日	6个月	新股锁定	29.80	36.94	6,203	184,849.40	229,138.82	-
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	5,445	168,740.55	168,740.55	-
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	31,719	121,166.58	121,166.58	-
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	-
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	3,447	115,991.55	115,991.55	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	5,244	115,000.92	115,000.92	-

688325	赛微微电	2022 年 4 月 15 日	6 个月	新股锁定	74.55	53.89	1,959	146,043.45	105,570.51	-
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	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁定	3.80	6.39	3,794	14,417.20	24,243.66	-
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	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股锁定	45.13	54.11	317	14,306.21	17,152.87	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股锁定	19.93	31.38	510	10,164.30	16,003.80	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	17.27	14.83	1,074	18,547.98	15,927.42	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	52.03	56.42	281	14,620.43	15,854.02	-
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	-
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	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	8.05	10.08	1,461	11,761.05	14,726.88	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	33.68	43.98	323	10,878.64	14,205.54	-
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	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	3.82	3.82	3,525	13,465.50	13,465.50	-
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	-

		日									
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁定	33.65	33.65	384	12,921.60	12,921.60		-
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		-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.07	29.87	390	15,237.30	11,649.30		-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定	23.21	16.14	699	16,221.46	11,281.86		-
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新股锁定	52.37	47.83	219	11,469.03	10,474.77		-
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		-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	109.04	82.76	120	13,084.80	9,931.20		-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.65	32.02	302	9,860.00	9,670.04		-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定	73.04	45.69	211	15,411.30	9,640.59		-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定	39.88	31.09	307	12,243.16	9,544.63		-
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		-
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		-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	96.46	87.82	101	9,742.88	8,869.82		-
301216	万凯	2022 年	6 个月	新股锁	35.68	29.84	294	10,489.92	8,772.96		-

	新材	3月21日		定							
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	297	10,092.06	8,601.12		-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	201	11,394.69	8,413.86		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	195	9,418.50	8,127.60		-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.46	352	10,848.64	7,553.92		-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	217	8,734.25	6,638.03		-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	165	10,411.50	6,575.25		-
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	436	43,600.00	43,608.22	-
118008	海优转债	2022年6月24日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	250	25,000.00	25,001.32	-

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	-	-
AAA 以下	70,034.18	-
未评级	-	-
合计	70,034.18	-

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	19,122,874.03	-	-	-	19,122,874.03
结算备付金	10,277.36	-	-	-	10,277.36
交易性金融资产	-	-	70,034.18	281,531,060.67	281,601,094.85
应收申购款	-	-	-	35,300.13	35,300.13
资产总计	19,133,151.39	-	70,034.18	281,566,360.80	300,769,546.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	967,633.83	967,633.83
应付管理人报酬	-	-	-	249,521.77	249,521.77
应付托管费	-	-	-	24,952.17	24,952.17
应付销售服务费	-	-	-	36,266.21	36,266.21
应交税费	-	-	-	35,451.51	35,451.51
其他负债	-	-	-	84,765.06	84,765.06
负债总计	-	-	-	1,398,590.55	1,398,590.55
利率敏感度缺口	19,133,151.39	-	70,034.18	280,167,770.25	299,370,955.82
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	33,391,005.01	-	-	-	33,391,005.01
结算备付金	6,878,421.62	-	-	-	6,878,421.62
存出保证金	2,250,186.40	-	-	-	2,250,186.40
交易性金融资产	-	-	-	310,230,318.41	310,230,318.41
应收申购款	-	-	-	22,058.33	22,058.33
其他资产	-	-	-	51,551.64	51,551.64
资产总计	42,519,613.03	-	-	310,303,928.38	352,823,541.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	162,303.59	162,303.59
应付托管费	-	-	-	16,230.35	16,230.35
应付销售服务费	-	-	-	23,725.96	23,725.96
负债总计	-	-	-	202,259.90	202,259.90
利率敏感度缺口	42,519,613.03	-	-	-310,101,668.48	352,621,281.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	利率增加 25 基点	-988.56	-
	利率减少 25 基点	1,005.28	-

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	281,531,060.67	94.04	310,230,318.41	87.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	70,034.18	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	281,601,094.85	94.06	310,230,318.41	87.98

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%	14,504,020.83	8,867,809.31
	业绩比较基准减少 5%	-14,504,020.83	-8,867,809.31

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	279,532,250.66	310,230,318.41
第二层次	800,643.33	-
第三层次	1,268,200.86	-
合计	281,601,094.85	310,230,318.41

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	281,531,060.67	93.60
	其中：股票	281,531,060.67	93.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,034.18	0.02

	其中：债券	70,034.18	0.02
	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	19,133,151.39	6.36
8	其他各项资产	35,300.13	0.01
9	合计	300,769,546.37	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 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,286,644.76	0.43
B	采矿业	7,834,232.20	2.62
C	制造业	140,769,724.87	47.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,219,787.00	3.08
E	建筑业	2,737,464.00	0.91
F	批发和零售业	5,307,382.20	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	8,015,375.10	2.68
H	住宿和餐饮业	7,440.00	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,534,958.00	4.86
J	金融业	16,776,167.75	5.60
K	房地产业	8,081,930.00	2.70
L	租赁和商务服务业	5,636,954.00	1.88
M	科学研究和技术服务业	500,720.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,729,635.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,106,890.00	1.04
R	文化、体育和娱乐	3,280,999.00	1.10

	乐业		
S	综合	3,564,222.00	1.19
	合计	232,390,525.88	77.63

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 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	595,656.00	0.20
B	采矿业	492,325.00	0.16
C	制造业	33,149,008.88	11.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,938.00	0.03
E	建筑业	1,052,732.00	0.35
F	批发和零售业	1,173,824.80	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	678,339.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,819,688.67	1.61
J	金融业	3,817,146.00	1.28
K	房地产业	1,142,061.00	0.38
L	租赁和商务服务业	87,612.63	0.03
M	科学研究和技术服务业	664,665.66	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	294,669.96	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	82,859.00	0.03
Q	卫生和社会工作	254,153.19	0.08
R	文化、体育和娱乐业	759,855.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	49,140,534.79	16.41

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。

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300724	捷佳伟创	37,900	3,386,365.00	1.13
2	600673	东阳光	355,500	3,195,945.00	1.07
3	300244	迪安诊断	99,900	3,106,890.00	1.04
4	002407	多氟多	62,200	3,042,202.00	1.02
5	600160	巨化股份	230,000	3,024,500.00	1.01
6	000738	航发控制	105,100	2,953,310.00	0.99
7	600839	四川长虹	1,008,400	2,904,192.00	0.97
8	000960	锡业股份	173,100	2,902,887.00	0.97
9	600823	世茂股份	949,000	2,828,020.00	0.94
10	002390	信邦制药	407,400	2,815,134.00	0.94
11	002756	永兴材料	18,100	2,755,001.00	0.92
12	600141	兴发集团	62,500	2,749,375.00	0.92
13	600415	小商品城	471,000	2,623,470.00	0.88
14	600392	盛和资源	115,400	2,608,040.00	0.87
15	000060	中金岭南	581,900	2,595,274.00	0.87
16	002409	雅克科技	46,700	2,592,317.00	0.87
17	000415	渤海租赁	1,188,000	2,577,960.00	0.86
18	002294	信立泰	91,400	2,568,340.00	0.86
19	600546	山煤国际	126,900	2,469,474.00	0.82
20	603267	鸿远电子	18,000	2,417,940.00	0.81
21	600499	科达制造	114,700	2,367,408.00	0.79
22	002507	涪陵榨菜	68,000	2,347,360.00	0.78
23	688521	芯原股份	45,771	2,261,087.40	0.76
24	600157	永泰能源	1,420,900	2,259,231.00	0.75
25	601615	明阳智能	66,200	2,237,560.00	0.75
26	300699	光威复材	37,200	2,189,964.00	0.73
27	002028	思源电气	61,100	2,178,826.00	0.73
28	300363	博腾股份	27,400	2,136,926.00	0.71
29	600236	桂冠电力	348,200	2,120,538.00	0.71
30	601005	重庆钢铁	1,078,700	2,060,317.00	0.69
31	000709	河钢股份	908,500	2,053,210.00	0.69
32	600522	中天科技	88,400	2,042,040.00	0.68
33	002212	天融信	199,100	2,020,865.00	0.68
34	603605	珀莱雅	12,220	2,018,499.60	0.67
35	300418	昆仑万维	125,500	2,008,000.00	0.67
36	600580	卧龙电驱	138,900	2,002,938.00	0.67
37	600120	浙江东方	475,000	1,904,750.00	0.64

38	600985	淮北矿业	129,500	1,885,520.00	0.63
39	601162	天风证券	584,600	1,859,028.00	0.62
40	300308	中际旭创	56,800	1,763,640.00	0.59
41	000156	华数传媒	205,200	1,635,444.00	0.55
42	600967	内蒙一机	178,000	1,623,360.00	0.54
43	601866	中远海发	538,500	1,615,500.00	0.54
44	600765	中航重机	49,060	1,578,750.80	0.53
45	000598	兴蓉环境	307,800	1,572,858.00	0.53
46	603456	九洲药业	30,400	1,571,680.00	0.52
47	600256	广汇能源	147,300	1,552,542.00	0.52
48	002468	申通快递	128,300	1,529,336.00	0.51
49	688208	道通科技	46,394	1,527,290.48	0.51
50	600022	山东钢铁	875,200	1,522,848.00	0.51
51	603198	迎驾贡酒	23,200	1,511,248.00	0.50
52	600325	华发股份	198,600	1,503,402.00	0.50
53	002625	光启技术	86,700	1,497,309.00	0.50
54	002266	浙富控股	312,500	1,496,875.00	0.50
55	001872	招商港口	95,800	1,494,480.00	0.50
56	600901	江苏租赁	287,700	1,475,901.00	0.49
57	601699	潞安环能	100,700	1,472,234.00	0.49
58	688390	固德威	4,700	1,471,147.00	0.49
59	601128	常熟银行	189,300	1,446,252.00	0.48
60	600376	首开股份	288,000	1,414,080.00	0.47
61	600487	亨通光电	95,500	1,388,570.00	0.46
62	688099	晶晨股份	13,641	1,377,741.00	0.46
63	000729	燕京啤酒	141,300	1,364,958.00	0.46
64	600705	中航产融	392,100	1,356,666.00	0.45
65	600970	中材国际	138,200	1,339,158.00	0.45
66	002131	利欧股份	688,300	1,335,302.00	0.45
67	000553	安道麦 A	109,300	1,323,623.00	0.44
68	600566	济川药业	46,900	1,273,804.00	0.43
69	688006	杭可科技	18,140	1,270,888.40	0.42
70	600572	康恩贝	285,200	1,263,436.00	0.42
71	601991	大唐发电	517,400	1,257,282.00	0.42
72	600862	中航高科	44,500	1,250,450.00	0.42
73	600079	人福医药	77,700	1,243,200.00	0.42
74	600486	扬农化工	9,200	1,226,176.00	0.41
75	300009	安科生物	121,100	1,224,321.00	0.41
76	600563	法拉电子	5,800	1,189,928.00	0.40
77	601636	旗滨集团	93,100	1,187,025.00	0.40
78	600699	均胜电子	74,100	1,164,111.00	0.39
79	688122	西部超导	12,600	1,161,720.00	0.39

80	603355	莱克电气	43,800	1,105,074.00	0.37
81	002368	太极股份	57,400	1,102,654.00	0.37
82	002156	通富微电	68,400	1,053,360.00	0.35
83	300474	景嘉微	15,000	1,025,850.00	0.34
84	601869	长飞光纤	33,000	1,020,360.00	0.34
85	002002	鸿达兴业	274,000	1,016,540.00	0.34
86	600959	江苏有线	299,630	976,793.80	0.33
87	002387	维信诺	142,800	959,616.00	0.32
88	600516	方大炭素	123,890	941,564.00	0.31
89	002815	崇达技术	73,500	941,535.00	0.31
90	600582	天地科技	192,700	921,106.00	0.31
91	600875	东方电气	55,500	912,975.00	0.30
92	601872	招商轮船	156,400	900,864.00	0.30
93	600369	西南证券	222,900	884,913.00	0.30
94	000898	鞍钢股份	269,200	866,824.00	0.29
95	000988	华工科技	37,200	861,924.00	0.29
96	601077	渝农商行	231,900	858,030.00	0.29
97	600968	海油发展	332,400	857,592.00	0.29
98	002081	金螳螂	168,000	853,440.00	0.29
99	603658	安图生物	17,200	840,908.00	0.28
100	002416	爱施德	88,940	827,142.00	0.28
101	600390	五矿资本	166,200	812,718.00	0.27
102	601000	唐山港	305,100	787,158.00	0.26
103	600208	新湖中宝	279,300	770,868.00	0.26
104	600535	天士力	72,000	756,720.00	0.25
105	600885	宏发股份	18,060	755,811.00	0.25
106	600597	光明乳业	59,600	752,748.00	0.25
107	601456	国联证券	61,200	750,924.00	0.25
108	300037	新宙邦	14,120	742,147.20	0.25
109	002004	华邦健康	129,800	724,284.00	0.24
110	002867	周大生	46,200	717,486.00	0.24
111	603638	艾迪精密	33,960	696,180.00	0.23
112	000563	陕国投 A	222,000	692,640.00	0.23
113	600096	云天化	21,900	689,412.00	0.23
114	002831	裕同科技	23,100	682,605.00	0.23
115	002299	圣农发展	35,482	680,544.76	0.23
116	000750	国海证券	186,330	676,377.90	0.23
117	002958	青农商行	200,500	665,660.00	0.22
118	601860	紫金银行	229,900	659,813.00	0.22
119	600867	通化东宝	63,500	656,590.00	0.22
120	002985	北摩高科	11,130	651,995.40	0.22
121	601992	金隅集团	231,700	641,809.00	0.21

122	603379	三美股份	28,400	631,900.00	0.21
123	300618	寒锐钴业	10,400	602,368.00	0.20
124	000728	国元证券	95,900	596,498.00	0.20
125	300253	卫宁健康	67,900	596,162.00	0.20
126	002936	郑州银行	219,000	589,110.00	0.20
127	600201	生物股份	63,980	586,056.80	0.20
128	300257	开山股份	39,100	584,936.00	0.20
129	601019	山东出版	89,800	582,802.00	0.19
130	600282	南钢股份	184,000	579,600.00	0.19
131	603712	七一二	18,200	573,300.00	0.19
132	002078	太阳纸业	46,500	572,415.00	0.19
133	688188	柏楚电子	2,540	558,901.60	0.19
134	002152	广电运通	58,700	544,149.00	0.18
135	002180	纳思达	10,400	526,448.00	0.18
136	603939	益丰药房	9,900	523,017.00	0.17
137	002146	荣盛发展	172,300	522,069.00	0.17
138	603613	国联股份	5,860	519,196.00	0.17
139	300357	我武生物	9,800	509,894.00	0.17
140	603127	昭衍新药	4,400	500,720.00	0.17
141	000983	山西焦煤	36,700	491,413.00	0.16
142	600380	健康元	39,500	487,825.00	0.16
143	000686	东北证券	68,200	476,718.00	0.16
144	603077	和邦生物	110,900	472,434.00	0.16
145	600316	洪都航空	15,100	456,624.00	0.15
146	000401	冀东水泥	42,400	446,048.00	0.15
147	300463	迈克生物	20,700	424,143.00	0.14
148	601880	辽港股份	249,203	423,645.10	0.14
149	603317	天味食品	14,700	418,509.00	0.14
150	603650	彤程新材	12,800	417,024.00	0.14
151	300146	汤臣倍健	19,000	411,350.00	0.14
152	601828	美凯龙	67,200	407,232.00	0.14
153	000629	攀钢钒钛	106,700	405,460.00	0.14
154	000997	新大陆	30,600	404,226.00	0.14
155	603156	养元饮品	17,700	402,144.00	0.13
156	688180	君实生物	5,300	399,302.00	0.13
157	000878	云南铜业	35,000	398,650.00	0.13
158	000998	隆平高科	23,800	396,508.00	0.13
159	600171	上海贝岭	15,800	395,474.00	0.13
160	601168	西部矿业	33,400	395,122.00	0.13
161	601156	东航物流	19,700	390,060.00	0.13
162	603883	老百姓	11,440	387,587.20	0.13
163	600398	海澜之家	81,300	386,175.00	0.13

164	600297	广汇汽车	147,600	385,236.00	0.13
165	600299	安迪苏	40,200	385,116.00	0.13
166	600482	中国动力	24,200	380,182.00	0.13
167	002153	石基信息	23,860	378,658.20	0.13
168	600642	申能股份	66,300	376,584.00	0.13
169	002422	科伦药业	20,000	374,000.00	0.12
170	002223	鱼跃医疗	14,500	372,070.00	0.12
171	600027	华电国际	94,300	370,599.00	0.12
172	300482	万孚生物	9,100	370,461.00	0.12
173	002439	启明星辰	18,500	368,705.00	0.12
174	000009	中国宝安	27,300	368,277.00	0.12
175	002399	海普瑞	20,900	367,422.00	0.12
176	002745	木林森	37,400	365,398.00	0.12
177	000402	金融街	61,000	362,950.00	0.12
178	002690	美亚光电	16,570	359,237.60	0.12
179	601179	中国西电	76,700	358,956.00	0.12
180	002966	苏州银行	58,300	355,630.00	0.12
181	002191	劲嘉股份	33,100	354,832.00	0.12
182	600863	内蒙华电	95,500	348,575.00	0.12
183	002281	光迅科技	19,800	348,084.00	0.12
184	000778	新兴铸管	71,800	346,076.00	0.12
185	603866	桃李面包	20,800	344,240.00	0.11
186	601928	凤凰传媒	47,800	341,770.00	0.11
187	002384	东山精密	14,600	334,778.00	0.11
188	000807	云铝股份	33,800	333,944.00	0.11
189	601298	青岛港	61,000	333,670.00	0.11
190	002242	九阳股份	18,100	332,316.00	0.11
191	000519	中兵红箭	11,300	329,395.00	0.11
192	600167	联美控股	43,800	328,062.00	0.11
193	002244	滨江集团	37,600	325,240.00	0.11
194	002948	青岛银行	88,100	318,922.00	0.11
195	000937	冀中能源	42,700	318,542.00	0.11
196	600170	上海建工	105,100	318,453.00	0.11
197	300383	光环新网	30,000	312,600.00	0.10
198	601098	中南传媒	33,000	311,520.00	0.10
199	000513	丽珠集团	8,500	307,785.00	0.10
200	600038	中直股份	6,700	302,840.00	0.10
201	600298	安琪酵母	6,200	302,250.00	0.10
202	600648	外高桥	21,100	286,960.00	0.10
203	688002	睿创微纳	7,200	285,984.00	0.10
204	300832	新产业	6,000	270,660.00	0.09
205	688777	中控技术	3,700	269,212.00	0.09

206	000975	银泰黄金	27,500	267,850.00	0.09
207	002434	万里扬	30,800	263,340.00	0.09
208	002128	电投能源	18,100	259,192.00	0.09
209	600623	华谊集团	30,600	253,980.00	0.08
210	600233	圆通速递	12,400	252,836.00	0.08
211	002423	中粮资本	37,400	250,954.00	0.08
212	600008	首创环保	85,300	247,370.00	0.08
213	000959	首钢股份	50,700	241,332.00	0.08
214	000488	晨鸣纸业	41,700	235,188.00	0.08
215	603345	安井食品	1,400	235,018.00	0.08
216	000671	阳光城	107,000	234,330.00	0.08
217	000967	盈峰环境	46,000	232,760.00	0.08
218	002532	天山铝业	35,600	232,468.00	0.08
219	002595	豪迈科技	10,300	230,102.00	0.08
220	601333	广深铁路	105,200	229,336.00	0.08
221	300144	宋城演艺	14,800	227,180.00	0.08
222	601016	节能风电	46,400	222,720.00	0.07
223	600737	中粮糖业	29,600	222,592.00	0.07
224	600177	雅戈尔	33,300	220,779.00	0.07
225	002185	华天科技	23,200	217,616.00	0.07
226	603983	丸美股份	7,900	211,720.00	0.07
227	600598	北大荒	14,200	209,592.00	0.07
228	600704	物产中大	40,100	205,713.00	0.07
229	300390	天华超净	2,300	201,020.00	0.07
230	601003	柳钢股份	49,500	200,475.00	0.07
231	002505	鹏都农牧	58,800	199,332.00	0.07
232	600500	中化国际	29,800	198,170.00	0.07
233	600667	太极实业	25,400	187,452.00	0.06
234	600529	山东药玻	6,600	184,470.00	0.06
235	600399	抚顺特钢	10,200	182,580.00	0.06
236	600373	中文传媒	17,700	176,823.00	0.06
237	600143	金发科技	17,500	166,600.00	0.06
238	600315	上海家化	3,600	153,900.00	0.05
239	002203	海亮股份	12,600	145,530.00	0.05
240	000987	越秀金控	20,395	143,376.85	0.05
241	601958	金钼股份	15,705	138,832.20	0.05
242	000887	中鼎股份	7,400	134,976.00	0.05
243	600339	中油工程	43,000	124,270.00	0.04
244	603218	日月股份	4,700	119,380.00	0.04
245	002572	索菲亚	4,300	118,250.00	0.04
246	002497	雅化集团	3,600	117,540.00	0.04
247	000685	中山公用	15,100	115,968.00	0.04

248	000012	南玻 A	15,400	114,268.00	0.04
249	000717	韶钢松山	31,900	111,650.00	0.04
250	002557	洽洽食品	1,900	108,167.00	0.04
251	000559	万向钱潮	17,900	106,326.00	0.04
252	002946	新乳业	7,900	102,621.00	0.03
253	601568	北元集团	14,870	94,275.80	0.03
254	300769	德方纳米	220	89,909.60	0.03
255	002396	星网锐捷	3,900	88,296.00	0.03
256	000031	大悦城	20,300	81,200.00	0.03
257	600060	海信视像	6,400	80,000.00	0.03
258	002372	伟星新材	3,200	76,928.00	0.03
259	688321	微芯生物	2,861	72,068.59	0.02
260	000869	张裕 A	2,000	59,480.00	0.02
261	002653	海思科	3,000	48,330.00	0.02
262	603868	飞科电器	600	45,450.00	0.02
263	002683	广东宏大	1,600	44,528.00	0.01
264	002506	协鑫集成	11,900	44,268.00	0.01
265	600216	浙江医药	3,100	42,315.00	0.01
266	002019	亿帆医药	2,800	39,144.00	0.01
267	600039	四川路桥	3,700	38,961.00	0.01
268	600166	福田汽车	13,100	37,073.00	0.01
269	600418	江淮汽车	2,100	36,036.00	0.01
270	688029	南微医学	398	34,705.60	0.01
271	600718	东软集团	2,900	33,379.00	0.01
272	600377	宁沪高速	3,800	32,566.00	0.01
273	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.01
274	000537	广宇发展	2,200	28,578.00	0.01
275	002010	传化智联	4,400	28,292.00	0.01
276	000932	华菱钢铁	5,100	25,959.00	0.01
277	001203	大中矿业	2,200	24,860.00	0.01
278	601598	中国外运	6,200	24,056.00	0.01
279	603589	口子窖	400	23,444.00	0.01
280	000039	中集集团	1,500	20,775.00	0.01
281	600567	山鹰国际	7,200	19,944.00	0.01
282	002326	永太科技	600	19,758.00	0.01
283	603228	景旺电子	800	18,664.00	0.01
284	689009	九号公司	300	13,350.00	0.00
285	002563	森马服饰	2,000	11,840.00	0.00
286	600801	华新水泥	600	11,706.00	0.00
287	002195	二三四五	5,100	11,475.00	0.00
288	600064	南京高科	1,000	11,000.00	0.00
289	600755	厦门国贸	1,300	9,750.00	0.00

290	600258	首旅酒店	300	7,440.00	0.00
291	002465	海格通信	700	6,363.00	0.00
292	002739	万达电影	400	5,460.00	0.00
293	600153	建发股份	400	5,228.00	0.00
294	000062	深圳华强	400	5,080.00	0.00
295	300115	长盈精密	400	4,124.00	0.00
296	603719	良品铺子	100	2,863.00	0.00
297	603707	健友股份	100	2,820.00	0.00
298	600348	华阳股份	100	1,546.00	0.00
299	603056	德邦股份	100	1,343.00	0.00
300	601555	东吴证券	100	693.00	0.00
301	000630	铜陵有色	200	652.00	0.00
302	000783	长江证券	100	593.00	0.00
303	600350	山东高速	100	525.00	0.00
304	000540	中天金融	100	193.00	0.00
305	600871	石化油服	100	189.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688388	嘉元科技	27,500	2,333,925.00	0.78
2	600036	招商银行	42,300	1,785,060.00	0.60
3	688508	芯朋微	19,902	1,482,699.00	0.50
4	603290	斯达半导	2,700	1,041,930.00	0.35
5	300661	圣邦股份	4,550	828,191.00	0.28
6	600519	贵州茅台	400	818,000.00	0.27
7	300268	佳沃食品	26,900	800,275.00	0.27
8	688005	容百科技	5,716	739,879.04	0.25
9	002129	TCL 中环	12,300	724,347.00	0.24
10	600456	宝钛股份	11,600	689,040.00	0.23
11	600276	恒瑞医药	18,500	686,165.00	0.23
12	688707	振华新材	8,817	667,182.39	0.22
13	002179	中航光电	10,220	647,130.40	0.22
14	688111	金山办公	3,279	646,356.48	0.22
15	300777	中简科技	13,400	645,880.00	0.22
16	688516	奥特维	2,400	640,680.00	0.21
17	600570	恒生电子	14,100	613,914.00	0.21
18	000733	振华科技	4,500	611,865.00	0.20
19	688200	华峰测控	1,700	605,880.00	0.20
20	688159	有方科技	27,810	603,477.00	0.20
21	300428	立中集团	18,200	601,510.00	0.20
22	002984	森麒麟	19,200	597,312.00	0.20

23	600467	好当家	207,200	584,304.00	0.20
24	605358	立昂微	7,928	534,188.64	0.18
25	000625	长安汽车	30,200	523,064.00	0.17
26	600887	伊利股份	12,600	490,770.00	0.16
27	688586	江航装备	17,600	468,336.00	0.16
28	603501	韦尔股份	2,400	415,272.00	0.14
29	688680	海优新材	2,000	397,400.00	0.13
30	600873	梅花生物	34,700	391,416.00	0.13
31	002085	万丰奥威	72,700	390,399.00	0.13
32	603708	家家悦	26,800	381,632.00	0.13
33	300068	南都电源	24,700	378,898.00	0.13
34	688171	纬德信息	15,900	372,855.00	0.12
35	300398	飞凯材料	16,300	372,618.00	0.12
36	600219	南山铝业	100,400	370,476.00	0.12
37	601319	中国人保	71,700	362,802.00	0.12
38	688037	芯源微	2,500	362,425.00	0.12
39	600085	同仁堂	6,800	359,584.00	0.12
40	300133	华策影视	71,500	356,070.00	0.12
41	300274	阳光电源	3,600	353,700.00	0.12
42	600438	通威股份	5,700	341,202.00	0.11
43	002001	新和成	14,900	339,869.00	0.11
44	600908	无锡银行	60,300	339,489.00	0.11
45	601658	邮储银行	62,800	338,492.00	0.11
46	002343	慈文传媒	59,500	337,365.00	0.11
47	000926	福星股份	70,800	336,300.00	0.11
48	300843	胜蓝股份	14,700	335,748.00	0.11
49	002371	北方华创	1,200	332,544.00	0.11
50	601588	北辰实业	141,400	330,876.00	0.11
51	688800	瑞可达	2,600	328,406.00	0.11
52	000627	天茂集团	95,200	324,632.00	0.11
53	688058	宝兰德	5,967	324,127.44	0.11
54	688166	博瑞医药	13,400	323,610.00	0.11
55	002869	金溢科技	21,300	321,204.00	0.11
56	300121	阳谷华泰	29,000	311,170.00	0.10
57	300682	朗新科技	12,300	309,837.00	0.10
58	300196	长海股份	16,400	309,796.00	0.10
59	605006	山东玻纤	26,900	308,005.00	0.10
60	002615	哈尔斯	47,500	295,450.00	0.10
61	300226	上海钢联	12,800	289,920.00	0.10
62	603128	华贸物流	28,900	289,867.00	0.10
63	300726	宏达电子	4,700	287,499.00	0.10
64	300218	安利股份	20,100	286,827.00	0.10

65	300078	思创医惠	56,000	286,160.00	0.10
66	600649	城投控股	66,400	284,192.00	0.09
67	688320	禾川科技	6,048	279,478.08	0.09
68	600366	宁波韵升	21,700	273,420.00	0.09
69	300681	英搏尔	4,650	268,630.50	0.09
70	601618	中国中冶	76,500	267,750.00	0.09
71	688072	拓荆科技	1,908	266,700.24	0.09
72	600368	五洲交通	69,400	266,496.00	0.09
73	600746	江苏索普	22,900	265,182.00	0.09
74	000949	新乡化纤	71,200	259,168.00	0.09
75	688282	理工导航	5,400	259,038.00	0.09
76	688121	卓然股份	10,500	255,255.00	0.09
77	002555	三七互娱	12,000	254,760.00	0.09
78	600123	兰花科创	15,100	248,395.00	0.08
79	601898	中煤能源	23,500	243,930.00	0.08
80	688349	三一重能	6,203	229,138.82	0.08
81	601668	中国建筑	42,300	225,036.00	0.08
82	600779	水井坊	2,400	222,096.00	0.07
83	000090	天健集团	31,500	217,035.00	0.07
84	688601	力芯微	1,400	210,000.00	0.07
85	603259	药明康德	2,000	207,980.00	0.07
86	600111	北方稀土	5,900	207,444.00	0.07
87	688711	宏微科技	2,700	206,010.00	0.07
88	601601	中国太保	8,700	204,711.00	0.07
89	002375	亚厦股份	40,500	202,905.00	0.07
90	002050	三花智控	7,200	197,856.00	0.07
91	002419	天虹股份	27,400	195,362.00	0.07
92	688566	吉贝尔	10,300	189,314.00	0.06
93	000906	浙商中拓	20,700	187,956.00	0.06
94	603337	杰克股份	8,500	182,580.00	0.06
95	000333	美的集团	3,000	181,170.00	0.06
96	300668	杰恩设计	9,900	177,012.00	0.06
97	300211	亿通科技	20,500	176,505.00	0.06
98	002080	中材科技	6,300	173,250.00	0.06
99	603365	水星家纺	11,400	170,772.00	0.06
100	688322	奥比中光	5,445	168,740.55	0.06
101	603787	新日股份	11,300	167,692.00	0.06
102	301168	通灵股份	3,600	162,288.00	0.05
103	000423	东阿阿胶	4,200	155,190.00	0.05
104	600708	光明地产	61,900	152,893.00	0.05
105	300647	超频三	13,500	151,740.00	0.05
106	300636	同和药业	5,800	139,200.00	0.05

107	002597	金禾实业	3,200	138,656.00	0.05
108	688310	迈得医疗	6,200	138,074.00	0.05
109	000933	神火股份	10,500	137,340.00	0.05
110	300816	艾可蓝	4,500	136,710.00	0.05
111	601212	白银有色	49,100	135,516.00	0.05
112	301175	中科环保	35,244	134,632.08	0.04
113	600690	海尔智家	4,900	134,554.00	0.04
114	600643	爱建集团	21,800	129,274.00	0.04
115	301239	普瑞眼科	3,831	128,913.15	0.04
116	300887	谱尼测试	3,000	128,130.00	0.04
117	002949	华阳国际	9,500	127,300.00	0.04
118	002441	众业达	13,200	124,344.00	0.04
119	688536	思瑞浦	220	123,549.80	0.04
120	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.04
121	688116	天奈科技	700	118,636.00	0.04
122	601689	拓普集团	1,700	116,331.00	0.04
123	603882	金域医学	1,400	115,570.00	0.04
124	688400	凌云光	5,244	115,000.92	0.04
125	688981	中芯国际	2,499	112,879.83	0.04
126	300453	三鑫医疗	11,300	112,322.00	0.04
127	000759	中百集团	21,600	110,160.00	0.04
128	300621	维业股份	11,700	106,002.00	0.04
129	688325	赛微微电	1,959	105,570.51	0.04
130	600745	闻泰科技	1,200	102,132.00	0.03
131	600285	羚锐制药	7,400	92,722.00	0.03
132	300170	汉得信息	9,900	89,199.00	0.03
133	601628	中国人寿	2,800	87,024.00	0.03
134	000755	山西路桥	20,600	86,108.00	0.03
135	300192	科德教育	13,300	82,859.00	0.03
136	300230	永利股份	21,300	81,579.00	0.03
137	000890	法尔胜	18,600	78,678.00	0.03
138	002027	分众传媒	11,600	78,068.00	0.03
139	688195	腾景科技	2,788	77,283.36	0.03
140	002460	赣锋锂业	500	74,350.00	0.02
141	601127	小康股份	900	72,981.00	0.02
142	601318	中国平安	1,500	70,035.00	0.02
143	002697	红旗连锁	13,600	68,680.00	0.02
144	601998	中信银行	14,400	68,400.00	0.02
145	603096	新经典	3,600	66,420.00	0.02
146	688239	航宇科技	1,241	66,145.30	0.02
147	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
148	002981	朝阳科技	2,500	58,800.00	0.02

149	601339	百隆东方	10,900	55,372.00	0.02
150	000567	海德股份	3,700	54,760.00	0.02
151	002757	南兴股份	4,200	48,846.00	0.02
152	002773	康弘药业	2,900	43,326.00	0.01
153	300782	卓胜微	320	43,200.00	0.01
154	300487	蓝晓科技	700	42,700.00	0.01
155	601336	新华保险	1,300	41,847.00	0.01
156	000852	石化机械	5,800	39,440.00	0.01
157	300659	中孚信息	1,800	38,286.00	0.01
158	603590	康辰药业	1,400	37,492.00	0.01
159	600710	苏美达	6,300	37,170.00	0.01
160	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
161	000040	东旭蓝天	10,700	35,631.00	0.01
162	600795	国电电力	8,800	34,408.00	0.01
163	002042	华孚时尚	9,000	34,020.00	0.01
164	600035	楚天高速	10,400	34,008.00	0.01
165	300412	迦南科技	5,000	33,950.00	0.01
166	601933	永辉超市	7,700	32,956.00	0.01
167	300768	迪普科技	2,000	32,300.00	0.01
168	688560	明冠新材	900	30,816.00	0.01
169	002577	雷柏科技	2,700	30,618.00	0.01
170	600877	声光电科	2,600	29,068.00	0.01
171	000002	万 科 A	1,400	28,700.00	0.01
172	002032	苏 泊 尔	500	28,170.00	0.01
173	002830	名雕股份	2,400	25,464.00	0.01
174	301215	中汽股份	3,794	24,243.66	0.01
175	688316	青云科技	612	22,068.72	0.01
176	688733	壹石通	300	22,017.00	0.01
177	688196	卓越新能	281	21,637.00	0.01
178	300567	精测电子	500	21,600.00	0.01
179	603335	迪生力	3,300	19,932.00	0.01
180	300327	中颖电子	400	19,924.00	0.01
181	603101	汇嘉时代	3,100	19,561.00	0.01
182	300735	光弘科技	1,800	18,810.00	0.01
183	688071	华依科技	400	18,496.00	0.01
184	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.01
185	301162	国能日新	317	17,152.87	0.01
186	301263	泰恩康	510	16,003.80	0.01
187	688368	晶丰明源	100	15,986.00	0.01
188	301217	铜冠铜箔	1,074	15,927.42	0.01
189	301302	华如科技	281	15,854.02	0.01
190	000951	中国重汽	1,200	15,588.00	0.01

191	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.01
192	688167	炬光科技	100	14,875.00	0.00
193	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
194	301256	华融化学	1,461	14,726.88	0.00
195	301153	中科江南	323	14,205.54	0.00
196	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
197	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
198	300515	三德科技	1,200	12,240.00	0.00
199	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
200	600426	华鲁恒升	400	11,680.00	0.00
201	301248	杰创智能	390	11,649.30	0.00
202	300970	华绿生物	600	11,352.00	0.00
203	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
204	301109	军信股份	699	11,281.86	0.00
205	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
206	301097	天益医疗	219	10,474.77	0.00
207	300542	新晨科技	900	10,350.00	0.00
208	688418	震有科技	1,100	10,340.00	0.00
209	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
210	688690	纳微科技	127	10,262.87	0.00
211	301150	中一科技	120	9,931.20	0.00
212	301103	何氏眼科	302	9,670.04	0.00
213	301206	三元生物	211	9,640.59	0.00
214	301102	兆讯传媒	307	9,544.63	0.00
215	002345	潮宏基	2,000	9,180.00	0.00
215	300476	胜宏科技	500	9,180.00	0.00
217	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
218	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
219	688607	康众医疗	347	8,910.96	0.00
220	301219	腾远钴业	101	8,869.82	0.00
221	000046	泛海控股	5,800	8,816.00	0.00
222	301216	万凯新材	294	8,772.96	0.00
223	600048	保利发展	500	8,730.00	0.00
224	301222	浙江恒威	297	8,601.12	0.00
225	603030	全筑股份	2,800	8,540.00	0.00
226	301237	和顺科技	201	8,413.86	0.00
227	301258	富士莱	195	8,127.60	0.00
228	688191	智洋创新	448	7,616.00	0.00
229	301151	冠龙节能	352	7,553.92	0.00
230	688553	汇宇制药	297	7,214.13	0.00
231	300719	安达维尔	700	7,161.00	0.00
232	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

233	688314	康拓医疗	138	6,699.90	0.00
234	605055	迎丰股份	1,000	6,690.00	0.00
235	301181	标榜股份	217	6,638.03	0.00
236	301110	青木股份	165	6,575.25	0.00
237	688056	莱伯泰科	177	6,495.90	0.00
238	301221	光庭信息	100	6,483.00	0.00
239	600023	浙能电力	1,700	5,899.00	0.00
240	300787	海能实业	200	5,788.00	0.00
241	688078	龙软科技	100	4,947.00	0.00
242	688117	圣诺生物	154	4,473.70	0.00
243	688728	格科微	161	3,302.11	0.00
244	002459	晶澳科技	40	3,156.00	0.00
245	688360	德马科技	100	2,662.00	0.00
246	688158	优刻得	158	2,295.74	0.00
247	000885	城发环境	200	1,860.00	0.00
248	002961	瑞达期货	100	1,804.00	0.00
249	603339	四方科技	100	1,144.00	0.00
250	601698	中国卫通	100	1,131.00	0.00
251	600748	上实发展	100	370.00	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	300418	昆仑万维	8,428,281.00	2.39
2	000975	银泰黄金	6,945,791.08	1.97
3	600884	杉杉股份	6,907,348.00	1.96
4	603290	斯达半导	6,847,450.00	1.94
5	300699	光威复材	6,793,690.00	1.93
6	601872	招商轮船	6,714,959.60	1.90
7	600233	圆通速递	6,574,348.92	1.86
8	601880	辽港股份	6,550,724.13	1.86
9	600256	广汇能源	6,435,213.00	1.82
10	600157	永泰能源	6,309,645.00	1.79
11	600141	兴发集团	6,281,763.00	1.78
12	000960	锡业股份	6,129,187.36	1.74
13	002594	比亚迪	6,027,362.00	1.71
14	600967	内蒙一机	5,976,980.00	1.70
15	000553	安道麦 A	5,974,719.00	1.69
16	000656	金科股份	5,928,570.00	1.68
17	300751	迈为股份	5,901,674.90	1.67
18	600580	卧龙电驱	5,827,974.43	1.65

19	603707	健友股份	5,775,772.65	1.64
20	688521	芯原股份	5,731,410.08	1.63

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	300751	迈为股份	8,659,057.60	2.46
2	688005	容百科技	7,958,734.44	2.26
3	300418	昆仑万维	7,631,922.00	2.16
4	601958	金钼股份	7,504,829.94	2.13
5	300037	新宙邦	7,450,482.77	2.11
6	000733	振华科技	7,431,566.00	2.11
7	002244	滨江集团	7,360,705.69	2.09
8	600233	圆通速递	7,352,146.42	2.08
9	600256	广汇能源	7,322,589.67	2.08
10	300285	国瓷材料	7,188,595.00	2.04
11	000975	银泰黄金	6,989,680.40	1.98
12	000630	铜陵有色	6,424,860.00	1.82
13	002203	海亮股份	6,396,422.00	1.81
14	601689	拓普集团	6,376,493.30	1.81
15	300750	宁德时代	6,194,771.00	1.76
16	600157	永泰能源	6,070,733.00	1.72
17	002594	比亚迪	6,042,651.00	1.71
18	600884	杉杉股份	6,039,846.00	1.71
19	601880	辽港股份	6,032,778.00	1.71
20	601872	招商轮船	6,016,766.04	1.71

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,863,467,120.70
卖出股票收入（成交）总额	1,863,135,072.84

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）	70,034.18	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,034.18	0.02

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	127064	杭氧转债	436	43,608.22	0.01
2	118008	海优转债	250	25,001.32	0.01
3	113644	艾迪转债	10	1,187.11	0.00
4	127061	美锦转债	2	237.53	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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,300.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,300.13

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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 (%)
工银中证 500 六个月持有指数增强 A	2,988	70,121.29	10,911,116.88	5.21	198,611,304.43	94.79
工银中证 500 六个月持有指数增强 C	2,792	42,032.39	200,088.00	0.17	117,154,338.24	99.83
合计	5,780	56,553.09	11,111,204.88	3.40	315,765,642.67	96.60

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	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	8,654.41	0.00
	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	86,019.82	0.07
	合计	94,674.23	0.03

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	0
	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	0
	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银中证 500 六个月持有指数增强	工银中证 500 六个月持有指数增强
----	--------------------	--------------------

	A	C
基金合同生效日 (2021 年 12 月 14 日) 基金份额总额	222,136,943.55	127,947,826.06
本报告期期初基金份额总额	222,151,830.80	127,955,111.16
本报告期基金总申购份额	3,459,519.84	3,499,101.30
减: 本报告期基金总赎回份额	16,088,929.33	14,099,786.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	209,522,421.31	117,354,426.24

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, 基金管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚, 基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
西南证券	2	3,717,399,335.38	100.00	3,297,464.18	100.00	-

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。

表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

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(%)
西南证券	199,622.33	100.00	-	-	-	-

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、中国证监会准予工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强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