

# 工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数 证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>87</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	87
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	88
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	89
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	91
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	92
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	92
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	92
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	92
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	92
8.12 投资组合报告附注 .....	93
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>94</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	94
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	94
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	95
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	95
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>95</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>95</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	95
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	96
11.4 基金投资策略的改变 .....	96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	96
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	96
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	96
11.8 其他重大事件 .....	97
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>98</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	98
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>98</b>
13.1 备查文件目录 .....	98
13.2 存放地点 .....	98
13.3 查阅方式 .....	98

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	科技龙头 ETF
场内简称	科技龙头、科技龙头 ETF
基金主代码	516050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 21 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	848,228,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 2 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	工银瑞信基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	010-60836588
传真	010-66583158	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码	100033	100125

法定代表人	赵桂才	张佑君
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年 1 月 21 日 (基金合同生效日) -2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-162,415,132.80	-63,456,480.08
本期利润	-258,076,621.21	-105,650,537.47
加权平均基金份额本期利润	-0.3052	-0.1019
本期加权平均净值利润率	-45.88%	-11.23%
本期基金份额净值增长率	-34.21%	-9.23%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-341,636,058.17	-76,622,245.86
期末可供分配基金份额利润	-0.4028	-0.0923
期末基金资产净值	506,591,941.83	753,605,754.14
期末基金份额净值	0.5972	0.9077
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-40.28%	-9.23%

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。

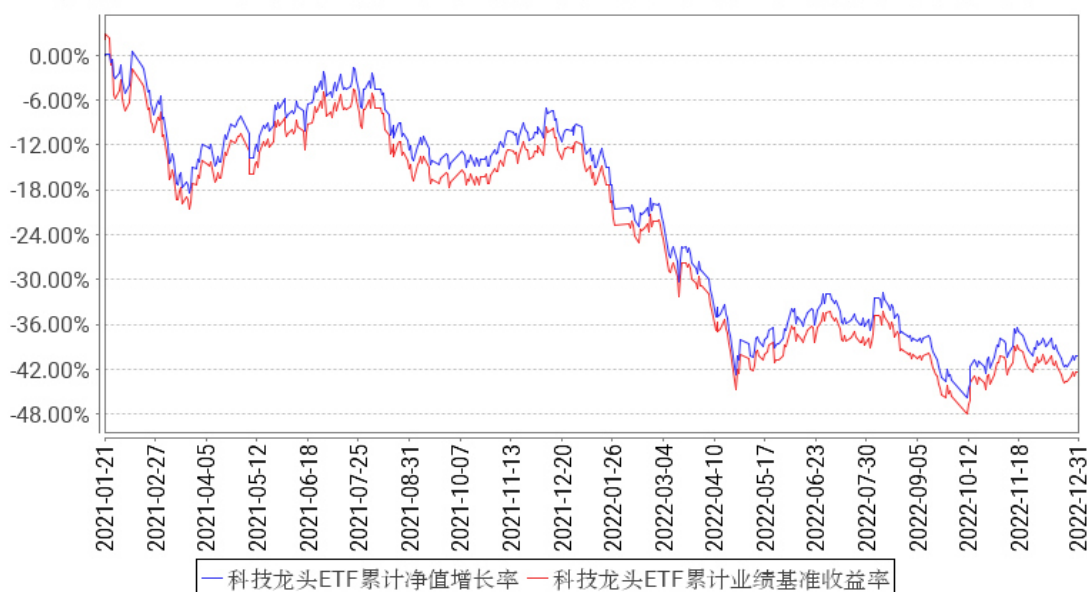
### 3.2 基金净值表现

#### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.49%	1.51%	5.80%	1.53%	-0.31%	-0.02%
过去六个月	-12.01%	1.42%	-12.08%	1.44%	0.07%	-0.02%
过去一年	-34.21%	1.62%	-34.84%	1.64%	0.63%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-40.28%	1.49%	-42.43%	1.54%	2.15%	-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

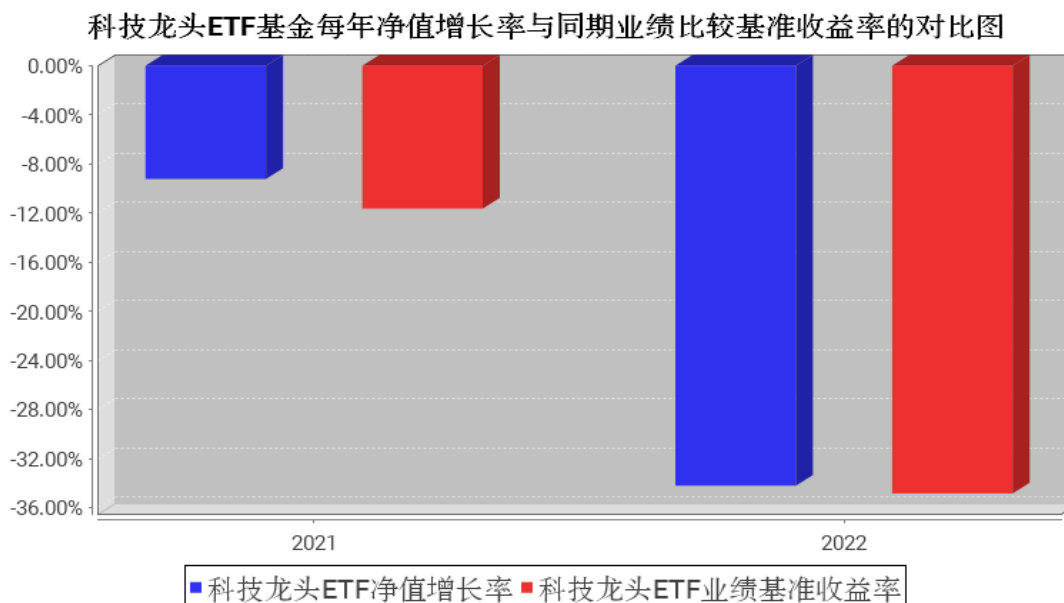
科技龙头ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 01 月 21 日生效。

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

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



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，为近 8300 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 12 月 31 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 227 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模超 1.72 万亿元，养老金管理规模居行业领先行列。

#### 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	本基金的基金经理	2021 年 1 月 21 日	-	12 年	博士。2010 年加入工银瑞信，曾任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数及量化投资部基金经理。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 日至今，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

				<p>放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019 年 10 月 17 日至 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 2023 年 1 月 5 日，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 2022 年 10 月 25 日，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 2023 年 1 月 5 日，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>
--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 8 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年，国内疫情反复下 A 股盈利超预期下行，年底防疫政策调整及房地产相关政策连续出台，同时海外还经历了局部战争和超高通胀。主要宽基指数在 2022 年均录到大幅负收益，成长风格跌幅更大。国内股票市场呈现明显结构性特征，全年新发基金规模大幅下降，IPO 规模维持高位。A 股市场在一季度大幅下跌，随着海外加息周期的开启，外资大幅流出，基金重仓股跌幅靠前，二季度成长风格占优，新能源汽车、光伏和储能等板块涨幅居前，下半年价值风格占优，能源、地产产业链和消费等板块超额收益显著。全年行业分化较大，多数行业录得负收益，涨幅最多的是煤炭、消费者服务和交通运输，涨幅分别为 17.5%、6.4% 和 2.3%，电子、计算机和国防军工是排名最后 3 位的行业，跌幅分别是 -35.7%、-25.2% 和 -25.1%。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 -34.21%，业绩比较基准收益率为 -34.84%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情防控的调整，以及各类稳增长政策发力，我们预计 2023 年 A 股基本面环境将有所改善。第一，增长方面，在疫情、地产管控政策放松和产业政策持续发力背景下，经济增长动能有望明显提高。第二，流动性方面，海外流动性改善方向确定，国内货币政策仍需发力，社融增速有望企稳并小幅回升，剩余流动性较 2022 年收窄但仍维持宽松。第三，企业盈利方面，预计全 A 盈利录得中低个位数增长，预计消费、金融地产、TMT 盈利增速较 2022 年回升，上游周期、中游制造盈利增速较 2022 年回落。

我们认为 2023 年 A 股市场的主线是盈利边际改善，流动性维持相对宽松，机会更多来自于盈利修复和困境反转。我们认为市场在 2022 年 12 月以来已经较为充分的反映了疫情之后经济环比修复的利好，经济数据同比修复以及行业中观数据的同比改善将会是市场未来上行的重要动力。在此基准框架下，我们认为 A 股的弹性来源于风险偏好和盈利的修复，成长风格将相对占优，在能源革命、数字化、自主可控等大趋势下，我们看好在未来多年具备广阔成长空间的优秀企业。

综合行业周期、估值、资金面、政策和市场交易特征，对各大产业链配置逻辑进行梳理，我们认为在 2023 年需要关注 TMT、信创、医药生物、军工和大消费等领域。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是严格的事前监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工相结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内。五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员和销售人员的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

#### (1) 职责分工

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

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

#### (2) 专业胜任能力及相关工作经历

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

#### 2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

#### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，工银瑞信基金管理有限公司在工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，

托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告期，由工银瑞信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23464 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“科技龙头 ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了科技龙头 ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于科技龙头 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	科技龙头 ETF 基金的基金管理人工银瑞信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和

	<p>中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估科技龙头 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算科技龙头 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督科技龙头 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对科技龙头 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致科技龙头 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	魏佳亮 朱寅婷



会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,948,452.47	7,751,821.62
结算备付金		174,121.97	488,904.18
存出保证金		97,171.35	186,617.97
交易性金融资产	7.4.7.2	502,247,325.06	746,121,591.22
其中：股票投资		502,247,325.06	746,121,591.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	99,101.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	21,096.07	11,773.50
资产总计		507,488,166.92	754,659,810.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		153.89	651.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		196,942.87	292,209.84
应付托管费		30,635.59	45,454.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,750.31	1,495.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	665,742.43	714,244.50
负债合计		896,225.09	1,054,055.87
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	848,228,000.00	830,228,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-341,636,058.17	-76,622,245.86
净资产合计		506,591,941.83	753,605,754.14
负债和净资产总计		507,488,166.92	754,659,810.01

注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 1 月 21 日，上年度可比期间财务报表的实际编制期间系 2021 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止，下同。

2、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.5972 元，基金份额总额为 848,228,000.00 份。

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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 21 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-254,785,760.06	-97,221,404.63
1. 利息收入		1,089,625.81	1,022,739.31
其中：存款利息收入	7.4.7.13	139,810.84	761,512.80
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		949,814.97	261,226.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-160,237,980.13	-58,281,197.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-165,578,067.85	-63,185,590.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	5,340,087.72	4,904,392.96
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）	7.4.7.20	-95,661,488.41	-42,194,057.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	24,082.67	2,231,110.62
<b>减：二、营业总支出</b>		3,290,861.15	8,429,132.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,537,689.76	4,001,499.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	394,751.66	622,455.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,419.73	940.47
8. 其他费用	7.4.7.23	355,000.00	3,804,237.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-258,076,621.21	-105,650,537.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-258,076,621.21	-105,650,537.47
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		-258,076,621.21	-105,650,537.47

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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额，下同。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	830,228,000.00	-	-76,622,245.86	753,605,754.14
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）	830,228,000.00	-	-76,622,245.86	753,605,754.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	18,000,000.00	-	-265,013,812.31	-247,013,812.31
（一）、综合收益总额	-	-	-258,076,621.21	-258,076,621.21
（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）	18,000,000.00	-	-6,937,191.10	11,062,808.90
其中：1. 基金申购款	169,000,000.00	-	-55,946,717.43	113,053,282.57
2. 基金赎回款	-151,000,000.00	-	49,009,526.33	-101,990,473.67
（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）	848,228,000.00	-	-341,636,058.17	506,591,941.83
项目	上年度可比期间			
	2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31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）	-	-	-	-
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）	1,224,228,000.00	-	-	1,224,228,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-394,000,000.00	-	-76,622,245.86	-470,622,245.86
（一）、综合收益总额	-	-	-105,650,537.47	-105,650,537.47
（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）	-394,000,000.00	-	29,028,291.61	-364,971,708.39
其中：1. 基金申购款	385,000,000.00	-	-30,913,969.84	354,086,030.16
2. 基金赎回款	-779,000,000.00	-	59,942,261.45	-719,057,738.55
（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)	830,228,000.00	-	-76,622,245.86	753,605,754.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]第 3219 号《关于准予工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,224,228,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0030 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2021 年 1 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,224,228,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间系 2021 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：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。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本



基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金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。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，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。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，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。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。本基金以使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特

点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每份基金份额收益分配金额后可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### 1、金融工具

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。

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、应收申购款和其他资产，金额分别为 7,751,821.62 元、488,904.18 元、186,617.97 元、0.00 元、99,101.52 元、11,773.50 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 7,755,412.24 元、489,160.09 元、186,710.26 元、0.00 元、99,101.52 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、7,834.68 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 746,121,591.22 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 746,121,591.22 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、651.43 元、0.00 元、292,209.84 元、45,454.91 元、0.00 元、286,714.93 元、0.00 元、427,529.57 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、651.43 元、0.00 元、292,209.84 元、45,454.91 元、0.00 元、286,714.93 元、0.00 元、427,529.57 元。

## 2、《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	4,948,452.47	7,751,821.62
等于：本金	4,946,362.29	7,751,821.62
加：应计利息	2,090.18	-
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	4,948,452.47	7,751,821.62

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元



项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	640,102,870.86	-	502,247,325.06	-137,855,545.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	640,102,870.86	-	502,247,325.06	-137,855,545.80
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	788,315,648.61	-	746,121,591.22	-42,194,057.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	788,315,648.61	-	746,121,591.22	-42,194,057.39

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 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。

##### 7.4.7.3.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	11,773.50
其他应收款	21,096.07	-
待摊费用	-	-
合计	21,096.07	11,773.50

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	171,829.06	286,714.93
其中：交易所市场	171,829.06	286,714.93
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	65,000.00	75,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
应退替代款	270,831.18	214,447.38
IOPV 服务费	38,082.19	18,082.19
合计	665,742.43	714,244.50

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	830,228,000.00	830,228,000.00
本期申购	169,000,000.00	169,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-151,000,000.00	-151,000,000.00
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	848,228,000.00	848,228,000.00

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

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-46,004,521.11	-30,617,724.75	-76,622,245.86
本期利润	-162,415,132.80	-95,661,488.41	-258,076,621.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,731,181.78	-4,206,009.32	-6,937,191.10
其中：基金申购款	-24,796,347.33	-31,150,370.10	-55,946,717.43
基金赎回款	22,065,165.55	26,944,360.78	49,009,526.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-211,150,835.69	-130,485,222.48	-341,636,058.17

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月

		31 日
活期存款利息收入	130,208.03	501,658.90
定期存款利息收入	-	99,166.67
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	7,805.40	150,786.32
其他	1,797.41	9,900.91
合计	139,810.84	761,512.80

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-148,125,738.64	-42,363,178.29
股票投资收益——赎回差价收入	-17,452,329.21	-20,822,411.84
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	-165,578,067.85	-63,185,590.13

##### 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	363,594,786.27	1,015,581,753.01
减：卖出股票成本总额	510,760,069.78	1,057,944,931.30
减：交易费用	960,455.13	-
买卖股票差价收入	-148,125,738.64	-42,363,178.29

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	-----------------------------	--

赎回基金份额对价总额	101,990,473.67	719,057,738.55
减：现金支付赎回款总额	57,994,425.67	473,687,420.55
减：赎回股票成本总额	61,448,377.21	266,192,729.84
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-17,452,329.21	-20,822,411.84

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月21日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利 收益	5,340,087.72	4,904,392.96
其中：证券出借权益补 偿收入	186,702.30	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	5,340,087.72	4,904,392.96

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日(基金合 同生效日)至2021年12月31 日
1. 交易性金融资产	-95,661,488.41	-42,194,057.39
股票投资	-95,661,488.41	-42,194,057.39
债券投资	-	-
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	-95,661,488.41	-42,194,057.39

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	24,082.67	1,899,154.08
其他	-	331,956.54
合计	24,082.67	2,231,110.62

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	65,000.00	75,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
IOPV 服务费	20,000.00	18,082.19
开户费	-	400.00
注册登记费	150,000.00	150,000.00
交易费用	-	3,440,755.42
合计	355,000.00	3,804,237.61

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	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

瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司
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	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至 2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中信证券股份有 限公司	746,062,178.69	100.00	3,031,418,683.78	100.00

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信证券股份有 限公司	537,774.17	100.00	171,829.06	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信证券股份有 限公司	2,156,253.55	100.00	286,714.93	100.00



注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中登结收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,537,689.76	4,001,499.26
其中：支付销售机构的客户维护费	73,800.84	115,508.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.45%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	394,751.66	622,455.50

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.07%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

##### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

## 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券股份有限公司	486,889,131.00	342,380.62	9,653,706.00	3,649.09
上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券股份有限公司	233,204,231.00	149,634.37	18,785,730.00	5,470.56

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券股份有限公司	2022010500010763	亿联网络	2022年1月5日	157,880.00	2,000	14	3.40	208.75	-	-
中信证券股份有限公司	2022010500010765	中科创达	2022年1月5日	519,520.00	4,000	14	3.40	686.92	-	-
中信证券股份有限公司	2022010500010767	卫宁健康	2022年1月5日	456,960.00	28,000	14	3.40	604.20	-	-
中信证券股份有限公司	2022010500010769	三环集团	2022年1月5日	729,640.00	17,000	14	3.40	964.75	-	-
中信证券股份有限公司	2022010500010771	同花顺	2022年1月5日	428,970.00	3,000	14	3.40	567.19	-	-

中信证券股份有限公司	2022010500010773	信维通信	2022年1月5日	378,150.00	15,000	14	3.40	500.00	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023190	中科创达	2022年1月14日	674,505.00	4,500	14	3.40	891.85	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023192	安克创新	2022年1月14日	213,923.00	2,300	14	3.40	282.85	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023194	龙腾光电	2022年1月14日	89,830.00	13,000	14	4.00	139.74	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023196	安克创新	2022年1月14日	186,020.00	2,000	14	3.40	245.96	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023198	中芯国际	2022年1月14日	510,900.00	10,000	14	4.00	794.73	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023200	华宇软件	2022年1月14日	203,280.00	16,500	14	3.40	268.78	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023202	三环集团	2022年1月14日	417,300.00	10,000	14	3.80	616.68	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023204	华宇软件	2022年1月14日	197,120.00	16,000	14	3.80	291.30	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023206	北京君正	2022年1月14日	421,200.00	4,000	14	3.80	622.44	-	-
中信证券股份有限公司	202201400023208	北京君正	2022年1月14日	368,550.00	3,500	14	3.40	487.31	-	-
中信证券股份有限公司	202201900011573	三环集团	2022年1月19日	696,320.00	17,000	14	3.40	1,249.51	-	-
中信证券股份有限公司	202201900011575	卫宁健康	2022年1月19日	432,040.00	28,000	14	3.40	775.27	-	-
中信证券股份有限公司	202201900011577	中科创达	2022年1月19日	598,640.00	4,000	14	3.40	1,074.23	-	-
中信证券股份有限公司	20220190001	同花顺	2022年1月19日	393,180.00	3,000	14	3.40	705.54	-	-

	1579		日								
中信证券股 份有限公司	202201 190001 1581	信维通 信	2022年 1月19 日	357,000. 00	15,000	14	3.40	640.61	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280001 8336	龙腾光 电	2022年 1月28 日	82,420.0 0	13,000	14	4.00	128.21	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280001 8338	中芯国 际	2022年 1月28 日	492,200. 00	10,000	14	4.00	765.64	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280001 8340	华宇软 件	2022年 1月28 日	183,680. 00	16,000	14	3.80	271.44	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0202	三环集 团	2022年 1月28 日	380,000. 00	10,000	14	3.80	561.56	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0204	北京君 正	2022年 1月28 日	435,600. 00	4,000	14	3.80	643.72	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0206	安克创 新	2022年 1月28 日	214,268. 00	2,300	14	3.40	283.31	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0208	安克创 新	2022年 1月28 日	186,320. 00	2,000	14	3.40	246.36	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0210	北京君 正	2022年 1月28 日	381,150. 00	3,500	14	3.40	503.97	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0212	中科创 达	2022年 1月28 日	621,000. 00	4,500	14	3.40	821.10	-	-	
中信证券股 份有限公司	202201 280002 0214	华宇软 件	2022年 1月28 日	189,420. 00	16,500	14	3.40	250.46	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 070004 6013	中科创 达	2022年 2月7日	561,400. 00	4,000	14	3.40	742.30	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 070004 6015	同花顺	2022年 2月7日	355,290. 00	3,000	14	3.40	469.77	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 070005 7261	卫宁健 康	2022年 2月7日	320,320. 00	28,000	14	3.40	423.53	-	-	
中信证券股	202202	三环集	2022年	635,290.	17,000	14	3.40	839.99	-	-	

份有限公司	070005 7263	团	2月7日	00							
中信证券股 份有限公司	202202 070005 7265	信维通 信	2022年 2月7日	324,150. 00	15,000	14	3.40	428.60	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 100000 0763	信维通 信	2022年 2月10 日	333,450. 00	15,000	14	3.60	466.83	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 100000 0764	安克创 新	2022年 2月10 日	289,080. 00	3,000	14	3.60	404.71	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 100000 0767	晶晨股 份	2022年 2月10 日	1,059,39 0.00	9,000	14	3.60	1,483. 15	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9070	龙腾光 电	2022年 2月11 日	83,330.0 0	13,000	14	4.00	129.62	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9072	北京君 正	2022年 2月11 日	417,280. 00	4,000	14	3.80	616.65	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9074	中芯国 际	2022年 2月11 日	514,600. 00	10,000	14	4.00	800.49	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9076	华宇软 件	2022年 2月11 日	187,680. 00	16,000	14	3.80	277.35	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9078	三环集 团	2022年 2月11 日	351,900. 00	10,000	14	3.80	520.03	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9080	北京君 正	2022年 2月11 日	365,120. 00	3,500	14	3.40	482.77	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9082	华宇软 件	2022年 2月11 日	193,545. 00	16,500	14	3.40	255.91	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9084	中科创 达	2022年 2月11 日	575,325. 00	4,500	14	3.40	760.71	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 110001 9086	安克创 新	2022年 2月11 日	191,640. 00	2,000	14	3.40	253.39	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 210003 9503	同花顺	2022年 2月21 日	330,090. 00	3,000	14	3.40	436.45	-	-	

中信证券股份有限公司	202202 210003 9505	卫宁健康	2022年 2月21 日	329,840. 00	28,000	14	3.40	436.12	-	-
中信证券股份有限公司	202202 210003 9507	中科创达	2022年 2月21 日	528,800. 00	4,000	14	3.40	699.19	-	-
中信证券股份有限公司	202202 210003 9509	信维通信	2022年 2月21 日	337,050. 00	15,000	14	3.40	445.66	-	-
中信证券股份有限公司	202202 210003 9511	三环集团	2022年 2月21 日	581,400. 00	17,000	14	3.40	768.74	-	-
中信证券股份有限公司	202202 240000 9585	安克创新	2022年 2月24 日	288,000. 00	3,000	14	3.60	403.20	-	-
中信证券股份有限公司	202202 240001 2483	信维通信	2022年 2月24 日	317,250. 00	15,000	14	3.60	444.15	-	-
中信证券股份有限公司	202202 240001 2493	晶晨股份	2022年 2月24 日	1,105,83 0.00	9,000	14	3.60	1,548. 16	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250001 8967	中科创达	2022年 2月25 日	619,200. 00	4,500	14	3.40	818.72	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250001 8969	龙腾光电	2022年 2月25 日	84,110.0 0	13,000	14	4.00	130.84	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250001 8971	安克创新	2022年 2月25 日	186,080. 00	2,000	14	3.40	246.04	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250001 8973	中芯国际	2022年 2月25 日	507,300. 00	10,000	14	4.00	789.13	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250001 8975	华宇软件	2022年 2月25 日	183,360. 00	16,000	14	3.80	270.97	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250001 8977	三环集团	2022年 2月25 日	352,800. 00	10,000	14	3.80	521.36	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250002 1297	北京君正	2022年 2月25 日	391,650. 00	3,500	14	3.40	517.85	-	-
中信证券股份有限公司	202202 250002	华宇软件	2022年 2月25	189,090. 00	16,500	14	3.40	250.02	-	-

	1299		日								
中信证券股 份有限公司	202202 250002 1301	北京君 正	2022年 2月25 日	447,600. 00	4,000	14	3.80	661.45	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 280000 0591	卓胜微	2022年 2月28 日	2,426,85 0.00	9,000	14	3.60	3,397. 59	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 280000 0593	安克创 新	2022年 2月28 日	89,560.0 0	1,000	14	3.60	125.38	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 280000 0594	信维通 信	2022年 2月28 日	169,680. 00	8,000	14	3.60	237.55	-	-	
中信证券股 份有限公司	202202 280000 0597	华润微	2022年 2月28 日	586,700. 00	10,000	14	3.60	821.38	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 070003 8358	三环集 团	2022年 3月7日	552,500. 00	17,000	14	3.40	730.53	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 070003 8360	卫宁健 康	2022年 3月7日	294,000. 00	28,000	14	3.40	388.73	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 070003 8362	中科创 达	2022年 3月7日	383,560. 00	4,000	14	3.40	507.15	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 070003 8364	信维通 信	2022年 3月7日	302,700. 00	15,000	14	3.40	400.24	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 070003 8366	同花顺	2022年 3月7日	297,300. 00	3,000	14	3.40	393.10	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 100001 1640	安克创 新	2022年 3月10 日	218,910. 00	3,000	14	3.60	306.47	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 100001 1642	信维通 信	2022年 3月10 日	289,950. 00	15,000	14	3.60	405.93	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110000 0436	华润微	2022年 3月11 日	462,240. 00	8,000	14	3.60	647.14	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0354	北京君 正	2022年 3月11 日	408,360. 00	4,000	14	3.80	603.47	-	-	
中信证券股	202203	三环集	2022年	314,700.	10,000	14	3.80	465.06	-	-	

份有限公司	110002 0356	团	3月11 日	00							
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0358	龙腾光 电	2022年 3月11 日	80,080.0 0	13,000	14	4.00	124.57	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0360	华宇软 件	2022年 3月11 日	167,040. 00	16,000	14	3.80	246.85	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0362	中芯国 际	2022年 3月11 日	497,400. 00	10,000	14	4.00	773.73	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0364	北京君 正	2022年 3月11 日	357,315. 00	3,500	14	3.40	472.45	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0366	华宇软 件	2022年 3月11 日	172,260. 00	16,500	14	3.40	227.77	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0368	安克创 新	2022年 3月11 日	146,800. 00	2,000	14	3.40	194.10	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 110002 0370	中科创 达	2022年 3月11 日	441,000. 00	4,500	14	3.40	583.10	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 140000 5336	卓胜微	2022年 3月14 日	2,062,71 0.00	9,000	14	3.60	2,887. 79	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 140000 5338	安克创 新	2022年 3月14 日	69,980.0 0	1,000	14	3.60	97.97	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 140000 5340	华润微	2022年 3月14 日	566,300. 00	10,000	14	3.60	792.82	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 140000 5342	信维通 信	2022年 3月14 日	151,440. 00	8,000	14	3.60	212.02	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 160000 0501	龙腾光 电	2022年 3月16 日	57,900.0 0	10,000	14	4.00	90.07	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 210003 6653	卫宁健 康	2022年 3月21 日	268,800. 00	28,000	14	3.40	406.18	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 210003 6655	三环集 团	2022年 3月21 日	502,350. 00	17,000	14	3.40	759.11	-	-	



中信证券股份有限公司	202203 210003 6657	同花顺	2022年 3月21 日	289,170. 00	3,000	14	3.40	436.97	-	-
中信证券股份有限公司	202203 210003 6659	信维通信	2022年 3月21 日	280,500. 00	15,000	14	3.40	423.86	-	-
中信证券股份有限公司	202203 210003 6661	中科创达	2022年 3月21 日	432,080. 00	4,000	14	3.40	652.93	-	-
中信证券股份有限公司	202203 220000 0532	华宇软件	2022年 3月22 日	220,000. 00	22,000	14	3.40	311.67	-	-
中信证券股份有限公司	202203 240001 1263	安克创新	2022年 3月24 日	219,630. 00	3,000	14	3.60	307.48	-	-
中信证券股份有限公司	202203 240001 1265	信维通信	2022年 3月24 日	280,500. 00	15,000	14	3.60	392.70	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6982	安克创新	2022年 3月25 日	142,200. 00	2,000	14	3.40	188.02	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6984	三环集团	2022年 3月25 日	288,800. 00	10,000	14	3.80	426.78	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6986	中科创达	2022年 3月25 日	450,045. 00	4,500	14	3.40	595.06	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6988	华润微	2022年 3月25 日	462,400. 00	8,000	14	3.60	647.36	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6990	中芯国际	2022年 3月25 日	467,600. 00	10,000	14	4.00	727.38	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6992	龙腾光电	2022年 3月25 日	73,840.0 0	13,000	14	4.00	114.86	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6994	北京君正	2022年 3月25 日	329,035. 00	3,500	14	3.40	435.06	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001 6996	华宇软件	2022年 3月25 日	161,040. 00	16,500	14	3.40	212.93	-	-
中信证券股份有限公司	202203 250001	华宇软件	2022年 3月25	156,160. 00	16,000	14	3.80	230.77	-	-

	6998		日								
中信证券股 份有限公司	202203 250001 7000	北京君 正	2022年 3月25 日	376,040. 00	4,000	14	3.80	555.70	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 280000 5113	华润微	2022年 3月28 日	568,000. 00	10,000	14	3.60	795.20	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 280000 5115	信维通 信	2022年 3月28 日	147,360. 00	8,000	14	3.60	206.30	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 280000 5117	卓胜微	2022年 3月28 日	1,963,80 0.00	9,000	14	3.60	2,749. 32	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 280000 5119	安克创 新	2022年 3月28 日	66,680.0 0	1,000	14	3.60	93.35	-	-	
中信证券股 份有限公司	202203 300000 7199	龙腾光 电	2022年 3月30 日	58,600.0 0	10,000	14	4.00	91.16	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 060005 0829	中科创 达	2022年 4月6日	386,440. 00	4,000	14	3.40	510.96	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 060005 2667	三环集 团	2022年 4月6日	470,390. 00	17,000	14	3.40	621.96	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 060005 2669	华宇软 件	2022年 4月6日	215,160. 00	22,000	14	3.40	284.49	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 060005 2671	信维通 信	2022年 4月6日	265,650. 00	15,000	14	3.40	351.25	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 060005 2673	卫宁健 康	2022年 4月6日	266,280. 00	28,000	14	3.40	352.08	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 060005 2675	同花顺	2022年 4月6日	285,390. 00	3,000	14	3.40	377.35	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 070001 4094	安克创 新	2022年 4月7日	193,200. 00	3,000	14	3.60	270.48	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 070001 4096	信维通 信	2022年 4月7日	256,350. 00	15,000	14	3.60	358.89	-	-	
中信证券股	202204	安克创	2022年	124,240.	2,000	14	3.40	164.27	-	-	

份有限公司	080001 7471	新	4月8日	00							
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7473	华宇软 件	2022年 4月8日	146,560. 00	16,000	14	3.80	216.58	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7475	龙腾光 电	2022年 4月8日	75,010.0 0	13,000	14	4.00	116.68	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7477	中科创 达	2022年 4月8日	419,355. 00	4,500	14	3.40	554.48	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7479	华宇软 件	2022年 4月8日	151,140. 00	16,500	14	3.40	199.84	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7481	华润微	2022年 4月8日	419,840. 00	8,000	14	3.60	587.78	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7483	三环集 团	2022年 4月8日	276,300. 00	10,000	14	3.80	408.31	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7485	中芯国 际	2022年 4月8日	449,900. 00	10,000	14	4.00	699.84	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7487	北京君 正	2022年 4月8日	307,510. 00	3,500	14	3.40	406.60	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 080001 7489	北京君 正	2022年 4月8日	351,440. 00	4,000	14	3.80	519.35	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 110000 6589	华润微	2022年 4月11 日	482,500. 00	10,000	14	3.60	675.50	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 110000 6609	卓胜微	2022年 4月11 日	1,699,92 0.00	9,000	14	3.60	2,379. 89	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 110000 6611	安克创 新	2022年 4月11 日	60,050.0 0	1,000	14	3.60	84.07	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 120000 0523	信维通 信	2022年 4月12 日	412,000. 00	25,000	14	3.60	576.80	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 120000 0525	北京君 正	2022年 4月12 日	419,400. 00	5,000	14	3.60	587.16	-	-	

中信证券股份有限公司	202204120000527	晶晨股份	2022年4月12日	1,503,033.00	13,300	14	3.60	2,104.25	-	-
中信证券股份有限公司	2022041300009928	龙腾光电	2022年4月13日	55,100.00	10,000	14	4.00	85.71	-	-
中信证券股份有限公司	2022042000049718	华宇软件	2022年4月20日	198,220.00	22,000	14	3.40	280.81	-	-
中信证券股份有限公司	2022042100000576	华宇软件	2022年4月21日	25,470.00	3,000	14	3.60	35.66	-	-
中信证券股份有限公司	2022042100000578	晶晨股份	2022年4月21日	312,390.00	3,000	28	3.80	923.29	-	-
中信证券股份有限公司	2022042100013221	信维通信	2022年4月21日	235,950.00	15,000	14	3.60	330.33	-	-
中信证券股份有限公司	2022042100013529	安克创新	2022年4月21日	173,910.00	3,000	14	3.60	243.47	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200016348	北京君正	2022年4月22日	310,000.00	4,000	14	3.80	458.11	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200016350	华宇软件	2022年4月22日	135,300.00	16,500	14	3.40	178.90	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200016352	三环集团	2022年4月22日	278,100.00	10,000	14	3.80	410.97	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200016354	北京君正	2022年4月22日	271,250.00	3,500	14	3.40	358.65	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200017056	安克创新	2022年4月22日	115,200.00	2,000	14	3.40	152.32	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200017058	中芯国际	2022年4月22日	418,500.00	10,000	14	4.00	651.00	-	-
中信证券股份有限公司	2022042200017060	华润微	2022年4月22日	379,680.00	8,000	14	3.60	531.55	-	-
中信证券股份有限公司	202204220001	龙腾光电	2022年4月22日	65,910.00	13,000	14	4.00	102.53	-	-

	7062		日								
中信证券股 份有限公司	202204 220001 7064	中科创 达	2022年 4月22 日	385,200. 00	4,500	14	3.40	509.32	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 220001 7066	华宇软 件	2022年 4月22 日	131,200. 00	16,000	14	3.80	193.88	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 250000 4605	安克创 新	2022年 4月25 日	53,600.0 0	1,000	14	3.60	75.04	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 250000 4607	卓胜微	2022年 4月25 日	1,597,23 0.00	9,000	14	3.60	2,236. 12	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 250000 4609	华润微	2022年 4月25 日	455,500. 00	10,000	14	3.60	637.70	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 260000 7371	晶晨股 份	2022年 4月26 日	1,299,67 6.00	13,300	14	3.60	1,819. 55	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 260000 7373	北京君 正	2022年 4月26 日	354,850. 00	5,000	14	3.60	496.79	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 260000 7375	信维通 信	2022年 4月26 日	343,750. 00	25,000	14	3.60	481.25	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 270000 9621	龙腾光 电	2022年 4月27 日	46,700.0 0	10,000	14	4.00	72.64	-	-	
中信证券股 份有限公司	202204 280000 0650	卓胜微	2022年 4月28 日	1,209,78 0.00	6,600	14	3.40	1,599. 60	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 050006 2163	信维通 信	2022年 5月5日	224,400. 00	15,000	14	3.60	314.16	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 050006 2165	安克创 新	2022年 5月5日	170,910. 00	3,000	14	3.60	239.27	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 050006 2167	华宇软 件	2022年 5月5日	20,400.0 0	3,000	14	3.60	28.56	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 050006 2169	华宇软 件	2022年 5月5日	149,600. 00	22,000	14	3.40	197.80	-	-	
中信证券股	202205	北京君	2022年	283,920.	4,000	14	3.80	419.57	-	-	

份有限公司	060001 4413	正	5月6日	00							
中信证券股 份有限公司	202205 060001 4415	华宇软 件	2022年 5月6日	111,540. 00	16,500	14	3.40	147.48	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 4417	华宇软 件	2022年 5月6日	108,160. 00	16,000	14	3.80	159.84	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 4419	北京君 正	2022年 5月6日	248,430. 00	3,500	14	3.40	328.48	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 7713	三环集 团	2022年 5月6日	277,200. 00	10,000	14	3.80	409.64	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 7715	中科创 达	2022年 5月6日	431,595. 00	4,500	14	3.40	570.66	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 7717	安克创 新	2022年 5月6日	111,160. 00	2,000	14	3.40	146.98	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 7719	华润微	2022年 5月6日	376,560. 00	8,000	14	3.60	527.18	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 7721	中芯国 际	2022年 5月6日	396,000. 00	10,000	14	4.00	616.00	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 060001 7723	龙腾光 电	2022年 5月6日	58,760.0 0	13,000	14	4.00	91.40	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 090001 0273	安克创 新	2022年 5月9日	56,510.0 0	1,000	14	3.60	79.11	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 090001 0621	华润微	2022年 5月9日	465,500. 00	10,000	14	3.60	651.70	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 090001 0623	卓胜微	2022年 5月9日	1,519,02 0.00	9,000	14	3.60	2,126. 63	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 100001 3263	晶晨股 份	2022年 5月10 日	1,376,01 8.00	13,300	14	3.60	1,926. 43	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 100001 3265	信维通 信	2022年 5月10 日	378,750. 00	25,000	14	3.60	530.25	-	-	

中信证券股份有限公司	2022051100011264	龙腾光电	2022年5月11日	47,100.00	10,000	14	4.00	73.27	-	-
中信证券股份有限公司	2022051200009268	卓胜微	2022年5月12日	1,290,300.00	6,600	14	3.40	1,706.06	-	-
中信证券股份有限公司	2022051600000414	北京君正	2022年5月16日	393,300.00	5,000	14	3.60	550.62	-	-
中信证券股份有限公司	2022051600000416	金山办公	2022年5月16日	2,379,120.00	12,000	14	3.60	3,330.77	-	-
中信证券股份有限公司	2022051900049171	安克创新	2022年5月19日	183,660.00	3,000	14	3.60	257.12	-	-
中信证券股份有限公司	2022051900049173	信维通信	2022年5月19日	233,850.00	15,000	14	3.60	327.39	-	-
中信证券股份有限公司	2022051900053397	华宇软件	2022年5月19日	20,490.00	3,000	14	3.60	28.69	-	-
中信证券股份有限公司	2022051900053399	华宇软件	2022年5月19日	150,260.00	22,000	14	3.40	198.68	-	-
中信证券股份有限公司	2022051900053401	晶晨股份	2022年5月19日	317,610.00	3,000	28	3.80	938.71	-	-
中信证券股份有限公司	2022052000016154	华宇软件	2022年5月20日	114,840.00	16,500	14	3.40	184.38	-	-
中信证券股份有限公司	2022052000016156	中芯国际	2022年5月20日	428,800.00	10,000	14	4.00	809.95	-	-
中信证券股份有限公司	2022052000016158	龙腾光电	2022年5月20日	63,440.00	13,000	14	4.00	119.83	-	-
中信证券股份有限公司	2022052000016160	华宇软件	2022年5月20日	111,360.00	16,000	14	3.80	199.83	-	-
中信证券股份有限公司	2022052000016162	北京君正	2022年5月20日	339,840.00	4,000	14	3.80	609.83	-	-
中信证券股份有限公司	202205200001	北京君正	2022年5月20日	297,360.00	3,500	14	3.40	477.43	-	-

	6164		日								
中信证券股 份有限公司	202205 200001 6166	三环集 团	2022年 5月20 日	301,000. 00	10,000	14	3.80	540.13	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 200001 6168	华润微	2022年 5月20 日	417,840. 00	8,000	14	3.60	710.33	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 200001 6170	中科创 达	2022年 5月20 日	470,070. 00	4,500	14	3.40	754.73	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 200001 6948	安克创 新	2022年 5月20 日	126,200. 00	2,000	14	3.40	202.62	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 230000 5793	安克创 新	2022年 5月23 日	63,120.0 0	1,000	14	3.60	88.37	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 230000 5821	卓胜微	2022年 5月23 日	1,799,01 0.00	9,000	14	3.60	2,518. 61	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 240000 7442	晶晨股 份	2022年 5月24 日	1,370,56 5.00	13,300	14	3.60	1,918. 79	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 240000 7444	信维通 信	2022年 5月24 日	372,250. 00	25,000	14	3.60	521.15	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 250000 6789	龙腾光 电	2022年 5月25 日	47,100.0 0	10,000	14	4.00	73.27	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 300000 3524	金山办 公	2022年 5月30 日	2,404,80 0.00	12,000	3	3.60	721.44	-	-	
中信证券股 份有限公司	202205 300000 3526	北京君 正	2022年 5月30 日	468,450. 00	5,000	3	3.60	140.54	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 020002 2884	信维通 信	2022年 6月2日	236,850. 00	15,000	14	3.60	331.59	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 020002 2886	安克创 新	2022年 6月2日	192,900. 00	3,000	14	3.60	270.06	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 060000 9466	安克创 新	2022年 6月6日	132,000. 00	2,000	14	3.40	174.53	-	-	
中信证券股	202206	华润微	2022年	466,800.	8,000	14	3.60	653.52	-	-	



份有限公司	060000 9468		6月6日	00							
中信证券股 份有限公司	202206 060000 9470	中科创 达	2022年 6月6日	543,960. 00	4,500	14	3.40	719.24	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 060000 9472	北京君 正	2022年 6月6日	335,860. 00	3,500	14	3.40	444.08	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 060000 9474	三环集 团	2022年 6月6日	315,000. 00	10,000	14	3.80	465.50	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 060000 9476	北京君 正	2022年 6月6日	383,840. 00	4,000	14	3.80	567.23	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 060001 1848	卓胜微	2022年 6月6日	1,828,71 0.00	9,000	14	3.60	2,560. 19	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 060001 1850	安克创 新	2022年 6月6日	66,000.0 0	1,000	14	3.60	92.40	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 070000 7564	晶晨股 份	2022年 6月7日	1,431,74 5.00	13,300	14	3.60	2,004. 44	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 070000 7566	信维通 信	2022年 6月7日	395,000. 00	25,000	14	3.60	553.00	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 140000 1337	卓胜微	2022年 6月14 日	551,460. 00	3,000	14	3.40	729.15	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 160000 0374	亿联网 络	2022年 6月16 日	600,640. 00	8,000	14	3.60	840.90	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 160001 4067	晶晨股 份	2022年 6月16 日	321,810. 00	3,000	28	3.80	951.13	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 160001 4069	信维通 信	2022年 6月16 日	243,150. 00	15,000	14	3.60	340.41	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 160001 4071	安克创 新	2022年 6月16 日	185,580. 00	3,000	14	3.60	259.81	-	-	
中信证券股 份有限公司	202206 200000 1638	金山办 公	2022年 6月20 日	1,007,25 0.00	5,000	14	3.40	1,331. 81	-	-	

中信证券股份有限公司	2022062000012176	卓胜微	2022年6月20日	1,887,480.00	9,000	14	3.60	2,642.47	-	-
中信证券股份有限公司	2022062000012178	安克创新	2022年6月20日	63,610.00	1,000	14	3.60	89.05	-	-
中信证券股份有限公司	2022062100000734	金山办公	2022年6月21日	1,000,000.00	5,000	14	3.40	1,322.22	-	-
中信证券股份有限公司	2022062100008590	信维通信	2022年6月21日	413,000.00	25,000	14	3.60	578.20	-	-
中信证券股份有限公司	2022062100008592	晶晨股份	2022年6月21日	1,262,303.00	13,300	14	3.60	1,767.22	-	-
中信证券股份有限公司	2022062800009092	卓胜微	2022年6月28日	632,640.00	3,000	14	3.40	836.49	-	-
中信证券股份有限公司	2022062900000598	扬杰科技	2022年6月29日	1,120,000.00	16,000	14	3.40	1,480.89	-	-
中信证券股份有限公司	2022063000020457	安克创新	2022年6月30日	198,960.00	3,000	14	3.60	278.54	-	-
中信证券股份有限公司	2022063000020461	信维通信	2022年6月30日	252,750.00	15,000	14	3.60	353.85	-	-
中信证券股份有限公司	2022063000021113	亿联网络	2022年6月30日	609,200.00	8,000	14	3.60	852.88	-	-
中信证券股份有限公司	2022070400014722	金山办公	2022年7月4日	952,450.00	5,000	14	3.40	1,259.35	-	-
中信证券股份有限公司	2022070400014724	卓胜微	2022年7月4日	1,201,950.00	9,000	14	3.60	1,682.73	-	-
中信证券股份有限公司	2022070400014726	安克创新	2022年7月4日	80,750.00	1,000	14	3.60	113.05	-	-
中信证券股份有限公司	2022070500009100	信维通信	2022年7月5日	419,500.00	25,000	14	3.60	587.30	-	-
中信证券股份有限公司	202207050000	金山办公	2022年7月5日	914,500.00	5,000	14	3.40	1,209.17	-	-

	9102										
中信证券股 份有限公司	202207 060000 0548	中科创 达	2022年 7月6日	1,329,60 0.00	10,000	14	3.40	1,758. 03	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 060000 0550	安克创 新	2022年 7月6日	393,550. 00	5,000	14	3.40	520.36	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 060000 0552	中微公 司	2022年 7月6日	1,264,20 0.00	10,000	14	3.40	1,671. 55	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 120001 0101	卓胜微	2022年 7月12 日	357,570. 00	3,000	14	3.40	472.79	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 130002 5794	扬杰科 技	2022年 7月13 日	978,400. 00	16,000	14	3.40	1,293. 66	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 140001 4082	晶晨股 份	2022年 7月14 日	250,050. 00	3,000	28	3.80	739.04	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 140001 4084	亿联网 络	2022年 7月14 日	596,240. 00	8,000	14	3.60	834.74	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 140001 5554	安克创 新	2022年 7月14 日	247,140. 00	3,000	14	3.60	346.00	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 180000 0231	天华超 净	2022年 7月18 日	1,965,27 2.00	23,200	14	3.40	2,598. 53	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 180001 3909	金山办 公	2022年 7月18 日	879,550. 00	5,000	14	3.40	1,162. 96	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 180001 4645	安克创 新	2022年 7月18 日	79,400.0 0	1,000	14	3.60	111.16	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 180001 4647	卓胜微	2022年 7月18 日	942,120. 00	9,000	14	3.60	1,318. 97	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 190000 9942	金山办 公	2022年 7月19 日	885,000. 00	5,000	14	3.40	1,170. 17	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 190001 0016	信维通 信	2022年 7月19 日	435,000. 00	25,000	14	3.60	609.00	-	-	
中信证券股	202207	中微公	2022年	1,133,20	10,000	14	3.40	1,498.	-	-	

份有限公司	200001 4153	司	7月20 日	0.00					34		
中信证券股 份有限公司	202207 200001 5143	安克创 新	2022年 7月20 日	386,100. 00	5,000	14	3.40	510.51	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 200001 5145	中科创 达	2022年 7月20 日	1,395,00 0.00	10,000	14	3.40	1,844. 50	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 260000 0461	信维通 信	2022年 7月26 日	489,888. 00	28,800	14	3.20	609.64	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 260001 1188	卓胜微	2022年 7月26 日	301,470. 00	3,000	14	3.40	398.61	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 280001 4175	亿联网 络	2022年 7月28 日	612,560. 00	8,000	14	3.60	857.58	-	-	
中信证券股 份有限公司	202207 280001 4177	安克创 新	2022年 7月28 日	227,580. 00	3,000	14	3.60	318.61	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 010001 4927	天华超 净	2022年 8月1日	1,839,29 6.00	23,200	14	3.40	2,431. 96	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 010001 5071	安克创 新	2022年 8月1日	76,490.0 0	1,000	14	3.60	107.09	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 010001 5077	金山办 公	2022年 8月1日	870,000. 00	5,000	14	3.40	1,150. 33	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 020001 1901	信维通 信	2022年 8月2日	417,750. 00	25,000	14	3.60	584.85	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 020001 1907	金山办 公	2022年 8月2日	848,250. 00	5,000	14	3.40	1,121. 58	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 030001 5011	安克创 新	2022年 8月3日	358,900. 00	5,000	14	3.40	474.55	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 030001 6153	中科创 达	2022年 8月3日	1,464,80 0.00	10,000	14	3.40	1,936. 79	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 030001 6177	中微公 司	2022年 8月3日	1,333,00 0.00	10,000	14	3.40	1,762. 52	-	-	

中信证券股份有限公司	2022080500001016	扬杰科技	2022年8月5日	1,093,440.00	16,000	14	3.40	1,445.77	-	-
中信证券股份有限公司	2022080800000309	卓胜微	2022年8月8日	522,500.00	5,000	14	3.40	690.86	-	-
中信证券股份有限公司	2022080800000311	信维通信	2022年8月8日	108,360.00	6,000	14	3.40	143.28	-	-
中信证券股份有限公司	2022080900014124	信维通信	2022年8月9日	515,520.00	28,800	14	3.20	641.54	-	-
中信证券股份有限公司	2022080900014164	卓胜微	2022年8月9日	314,190.00	3,000	14	3.40	415.43	-	-
中信证券股份有限公司	2022081100012192	亿联网络	2022年8月11日	610,560.00	8,000	14	3.60	854.78	-	-
中信证券股份有限公司	2022081100012222	晶晨股份	2022年8月11日	294,600.00	3,000	28	3.80	870.71	-	-
中信证券股份有限公司	2022081500016477	安克创新	2022年8月15日	66,430.00	1,000	14	3.60	93.00	-	-
中信证券股份有限公司	2022081500016499	金山办公	2022年8月15日	933,300.00	5,000	14	3.40	1,234.03	-	-
中信证券股份有限公司	2022081500017373	天华超净	2022年8月15日	1,868,296.00	23,200	14	3.40	2,470.30	-	-
中信证券股份有限公司	2022081600010292	金山办公	2022年8月16日	885,000.00	5,000	14	3.40	1,170.17	-	-
中信证券股份有限公司	2022081600010348	信维通信	2022年8月16日	445,750.00	25,000	14	3.60	624.05	-	-
中信证券股份有限公司	2022081700015297	安克创新	2022年8月17日	336,400.00	5,000	14	3.40	444.80	-	-
中信证券股份有限公司	2022081700015327	中科创达	2022年8月17日	1,345,000.00	10,000	14	3.40	1,778.39	-	-
中信证券股份有限公司	202208170001	中微公司	2022年8月17日	1,390,000.00	10,000	14	3.40	1,837.89	-	-

	5337		日								
中信证券股 份有限公司	202208 220001 9959	卓胜微	2022年 8月22 日	499,500. 00	5,000	14	3.40	660.45	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 220001 9961	信维通 信	2022年 8月22 日	107,640. 00	6,000	14	3.40	142.32	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 230001 4868	卓胜微	2022年 8月23 日	294,360. 00	3,000	14	3.40	389.21	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 240000 1100	卓胜微	2022年 8月24 日	1,129,80 0.00	12,000	14	3.20	1,405. 97	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 250001 3642	亿联网 络	2022年 8月25 日	568,640. 00	8,000	14	3.60	796.10	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 290001 7091	天华超 净	2022年 8月29 日	1,838,13 6.00	23,200	14	3.40	2,604. 02	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 300000 0464	北京君 正	2022年 8月30 日	415,950. 00	5,000	14	3.40	549.98	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 300000 0467	三环集 团	2022年 8月30 日	137,100. 00	5,000	14	3.40	181.28	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 300001 2708	信维通 信	2022年 8月30 日	428,500. 00	25,000	14	3.60	599.90	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 310001 5142	安克创 新	2022年 8月31 日	307,300. 00	5,000	14	3.40	406.32	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 310001 5184	中科创 达	2022年 8月31 日	1,229,70 0.00	10,000	14	3.40	1,625. 94	-	-	
中信证券股 份有限公司	202208 310001 5200	中微公 司	2022年 8月31 日	1,231,80 0.00	10,000	14	3.40	1,628. 71	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 050000 0588	中科创 达	2022年 9月5日	1,321,21 0.00	11,000	14	3.40	1,746. 93	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 050002 6065	卓胜微	2022年 9月5日	493,000. 00	5,000	14	3.40	651.86	-	-	
中信证券股	202209	信维通	2022年	102,900.	6,000	14	3.40	136.06	-	-	

份有限公司	050002 6181	信	9月5日	00							
中信证券股 份有限公司	202209 060000 0327	扬杰科 技	2022年 9月6日	927,840. 00	16,000	14	3.40	1,226. 81	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 060001 3693	卓胜微	2022年 9月6日	293,580. 00	3,000	14	3.40	388.18	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 070003 2050	卓胜微	2022年 9月7日	1,187,64 0.00	12,000	14	3.20	1,477. 95	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 080001 4026	亿联网 络	2022年 9月8日	578,400. 00	8,000	14	3.60	809.76	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 130002 3585	北京君 正	2022年 9月13 日	391,300. 00	5,000	14	3.40	517.39	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 130002 3603	三环集 团	2022年 9月13 日	136,000. 00	5,000	14	3.40	179.82	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 130002 3665	信维通 信	2022年 9月13 日	413,750. 00	25,000	14	3.60	579.25	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 130002 7039	天华超 净	2022年 9月13 日	1,824,68 0.00	23,200	14	3.40	2,412. 63	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 140001 7920	中科创 达	2022年 9月14 日	1,200,40 0.00	10,000	14	3.40	1,587. 20	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 140001 7966	中微公 司	2022年 9月14 日	1,282,70 0.00	10,000	14	3.40	1,696. 01	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 140001 7998	安克创 新	2022年 9月14 日	299,350. 00	5,000	14	3.40	395.81	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 150000 0468	安克创 新	2022年 9月15 日	291,250. 00	5,000	14	3.40	385.10	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 190001 9566	中科创 达	2022年 9月19 日	1,243,88 0.00	11,000	14	3.40	2,467. 03	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 190001 9646	卓胜微	2022年 9月19 日	498,250. 00	5,000	14	3.40	988.20	-	-	

中信证券股份有限公司	202209200000414	三环集团	2022年9月20日	125,538.00	4,900	28	3.40	331.98	-	-
中信证券股份有限公司	2022092000015725	卓胜微	2022年9月20日	288,900.00	3,000	14	3.40	545.70	-	-
中信证券股份有限公司	2022092100024716	卓胜微	2022年9月21日	1,108,800.00	12,000	14	3.20	1,872.64	-	-
中信证券股份有限公司	2022092200000223	扬杰科技	2022年9月22日	337,545.00	6,500	14	3.40	573.83	-	-
中信证券股份有限公司	2022092200000225	金山办公	2022年9月22日	758,660.00	3,500	14	3.40	1,289.72	-	-
中信证券股份有限公司	2022092200010893	亿联网络	2022年9月22日	507,840.00	8,000	14	3.60	914.12	-	-
中信证券股份有限公司	2022092600000345	北京君正	2022年9月26日	574,480.00	8,000	14	3.40	759.59	-	-
中信证券股份有限公司	2022092600000347	扬杰科技	2022年9月26日	509,200.00	10,000	28	3.40	1,346.55	-	-
中信证券股份有限公司	2022092700026033	天华超净	2022年9月27日	1,614,256.00	23,200	14	3.40	2,134.41	-	-
中信证券股份有限公司	2022092700027979	三环集团	2022年9月27日	124,450.00	5,000	14	3.40	164.55	-	-
中信证券股份有限公司	2022092800015973	中微公司	2022年9月28日	1,105,000.00	10,000	14	3.40	1,461.06	-	-
中信证券股份有限公司	2022092800016123	安克创新	2022年9月28日	280,600.00	5,000	14	3.40	371.02	-	-
中信证券股份有限公司	2022092800016149	中科创达	2022年9月28日	1,087,100.00	10,000	14	3.40	1,437.39	-	-
中信证券股份有限公司	2022092900000373	三环集团	2022年9月29日	623,250.00	25,000	14	3.40	824.08	-	-
中信证券股份有限公司	202209290000	金山办公	2022年9月29日	1,332,500.00	6,500	28	3.40	3,523.72	-	-



	0375		日								
中信证券股 份有限公司	202209 290001 4133	安克创 新	2022年 9月29 日	283,250. 00	5,000	14	3.40	374.52	-	-	
中信证券股 份有限公司	202209 300000 0161	北京君 正	2022年 9月30 日	295,880. 00	4,000	14	3.40	391.22	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100007 9957	卓胜微	2022年 10月10 日	405,600. 00	5,000	14	3.40	536.29	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100008 0357	扬杰科 技	2022年 10月10 日	302,250. 00	6,500	14	3.40	399.64	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100008 1255	亿联网 络	2022年 10月10 日	498,400. 00	8,000	14	3.60	697.76	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100008 1285	金山办 公	2022年 10月10 日	696,220. 00	3,500	14	3.40	920.56	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100008 2845	中科创 达	2022年 10月10 日	1,128,05 0.00	11,000	14	3.40	1,491. 53	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100008 2863	卓胜微	2022年 10月10 日	243,360. 00	3,000	14	3.40	321.78	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100008 2883	卓胜微	2022年 10月10 日	973,440. 00	12,000	14	3.20	1,211. 39	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 100009 1245	北京君 正	2022年 10月10 日	528,720. 00	8,000	14	3.40	699.09	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 110002 4767	天华超 净	2022年 10月11 日	1,511,01 6.00	23,200	14	3.40	1,997. 90	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 110002 8439	三环集 团	2022年 10月11 日	127,100. 00	5,000	14	3.40	168.05	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 120001 8420	中科创 达	2022年 10月12 日	1,051,00 0.00	10,000	14	3.40	1,389. 66	-	-	
中信证券股 份有限公司	202210 120001 8478	安克创 新	2022年 10月12 日	270,800. 00	5,000	14	3.40	358.06	-	-	
中信证券股	202210	中微公	2022年	812,200.	10,000	14	3.40	1,073.	-	-	

份有限公司	120002 0936	司	10月12 日	00				91		
中信证券股 份有限公司	202210 130001 5906	三环集 团	2022年 10月13 日	679,250. 00	25,000	14	3.40	898.12	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 130001 6400	安克创 新	2022年 10月13 日	275,800. 00	5,000	14	3.40	364.67	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 140001 1752	北京君 正	2022年 10月14 日	280,280. 00	4,000	14	3.40	370.59	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 170000 0737	三环集 团	2022年 10月17 日	217,961. 00	7,900	28	3.40	576.39	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240008 0219	金山办 公	2022年 10月24 日	1,001,03 5.00	3,500	14	3.40	1,323. 59	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240008 3305	扬杰科 技	2022年 10月24 日	506,100. 00	10,000	28	3.40	1,338. 35	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240008 6807	扬杰科 技	2022年 10月24 日	328,965. 00	6,500	14	3.40	434.96	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240008 6889	亿联网 络	2022年 10月24 日	520,800. 00	8,000	14	3.60	729.12	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240008 6951	卓胜微	2022年 10月24 日	424,250. 00	5,000	14	3.40	560.95	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240008 7907	中科创 达	2022年 10月24 日	1,170,40 0.00	11,000	14	3.40	1,547. 53	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240009 1631	卓胜微	2022年 10月24 日	1,018,20 0.00	12,000	14	3.20	1,267. 09	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 240009 1735	卓胜微	2022年 10月24 日	254,550. 00	3,000	14	3.40	336.57	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 250002 5468	天华超 净	2022年 10月25 日	1,537,00 0.00	23,200	14	3.40	2,032. 26	-	-
中信证券股 份有限公司	202210 250002 5506	三环集 团	2022年 10月25 日	134,450. 00	5,000	14	3.40	177.77	-	-

中信证券股份有限公司	2022102600019168	安克创新	2022年10月26日	290,800.00	5,000	14	3.40	384.50	-	-
中信证券股份有限公司	2022102600022100	中科创达	2022年10月26日	1,047,300.00	10,000	14	3.40	1,384.76	-	-
中信证券股份有限公司	2022102600022180	中微公司	2022年10月26日	1,027,200.00	10,000	14	3.40	1,358.19	-	-
中信证券股份有限公司	2022102700019217	金山办公	2022年10月27日	1,756,950.00	6,500	28	3.40	4,646.16	-	-
中信证券股份有限公司	2022102700019287	安克创新	2022年10月27日	276,750.00	5,000	14	3.40	365.93	-	-
中信证券股份有限公司	2022102700019325	三环集团	2022年10月27日	708,500.00	25,000	14	3.40	936.79	-	-
中信证券股份有限公司	2022103100001773	北京君正	2022年10月31日	815,520.00	12,000	14	3.40	1,078.30	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700075497	扬杰科技	2022年11月7日	356,525.00	6,500	14	3.40	471.41	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700075779	亿联网络	2022年11月7日	549,840.00	8,000	14	3.60	769.78	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700076027	中科创达	2022年11月7日	1,309,000.00	11,000	14	3.40	1,730.79	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700079117	金山办公	2022年11月7日	962,395.00	3,500	14	3.40	1,272.50	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700079125	卓胜微	2022年11月7日	518,800.00	5,000	14	3.40	685.97	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700081747	卓胜微	2022年11月7日	311,280.00	3,000	14	3.40	411.58	-	-
中信证券股份有限公司	2022110700085559	卓胜微	2022年11月7日	1,245,120.00	12,000	14	3.20	1,549.48	-	-
中信证券股份有限公司	202211080002	三环集团	2022年11月8日	146,550.00	5,000	14	3.40	193.77	-	-

	4849		日								
中信证券股 份有限公司	202211 080002 5495	天华超 净	2022年 11月8 日	1,628,64 0.00	23,200	14	3.40	2,153. 42	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 090001 6999	安克创 新	2022年 11月9 日	289,400. 00	5,000	14	3.40	382.65	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 090001 8195	中微公 司	2022年 11月9 日	1,077,80 0.00	10,000	14	3.40	1,425. 09	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 090002 1209	中科创 达	2022年 11月9 日	1,187,10 0.00	10,000	14	3.40	1,569. 61	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 100001 8610	三环集 团	2022年 11月10 日	721,500. 00	25,000	14	3.40	953.98	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 100001 8650	安克创 新	2022年 11月10 日	287,400. 00	5,000	14	3.40	380.01	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210006 9168	扬杰科 技	2022年 11月21 日	594,900. 00	10,000	14	3.40	786.59	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210006 9252	中科创 达	2022年 11月21 日	1,341,89 0.00	11,000	14	3.40	1,774. 28	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210006 9288	金山办 公	2022年 11月21 日	940,170. 00	3,500	14	3.40	1,243. 11	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210006 9292	卓胜微	2022年 11月21 日	593,500. 00	5,000	14	3.40	784.74	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210006 9324	亿联网 络	2022年 11月21 日	540,000. 00	8,000	14	3.60	756.00	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210007 1600	扬杰科 技	2022年 11月21 日	386,685. 00	6,500	14	3.40	511.28	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210007 3370	卓胜微	2022年 11月21 日	356,100. 00	3,000	14	3.40	470.84	-	-	
中信证券股 份有限公司	202211 210007 3468	卓胜微	2022年 11月21 日	1,424,40 0.00	12,000	14	3.20	1,772. 59	-	-	
中信证券股	202211	天华超	2022年	1,443,50	23,200	14	3.40	1,908.	-	-	

份有限公司	220001 6773	净	11月22 日	4.00					63		
中信证券股 份有限公司	202211 220001 7805	三环集 团	2022年 11月22 日	149,600. 00	5,000	14	3.40	197.80		-	-
中信证券股 份有限公司	202211 230001 6682	安克创 新	2022年 11月23 日	296,650. 00	5,000	14	3.40	392.24		-	-
中信证券股 份有限公司	202211 230001 7162	中科创 达	2022年 11月23 日	1,196,80 0.00	10,000	14	3.40	1,582. 44		-	-
中信证券股 份有限公司	202211 230001 7170	中微公 司	2022年 11月23 日	1,009,40 0.00	10,000	14	3.40	1,334. 65		-	-
中信证券股 份有限公司	202211 240001 6856	金山办 公	2022年 11月24 日	1,668,09 5.00	6,500	14	3.40	2,205. 59		-	-
中信证券股 份有限公司	202211 240001 9456	三环集 团	2022年 11月24 日	737,500. 00	25,000	14	3.40	975.14		-	-
中信证券股 份有限公司	202211 240001 9504	安克创 新	2022年 11月24 日	297,800. 00	5,000	14	3.40	393.76		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 050001 9438	中科创 达	2022年 12月5 日	1,233,32 0.00	11,000	14	3.40	1,630. 72		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 050001 9522	扬杰科 技	2022年 12月5 日	370,500. 00	6,500	14	3.40	489.88		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 050002 1026	扬杰科 技	2022年 12月5 日	570,000. 00	10,000	14	3.40	753.67		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 070000 9592	中科创 达	2022年 12月7 日	1,131,10 0.00	10,000	14	3.40	1,495. 57		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 070000 9594	安克创 新	2022年 12月7 日	300,500. 00	5,000	14	3.40	397.33		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 070000 9616	中微公 司	2022年 12月7 日	1,048,70 0.00	10,000	14	3.40	1,386. 61		-	-
中信证券股 份有限公司	202212 080000 0648	中际旭 创	2022年 12月8 日	704,000. 00	25,000	14	3.40	930.84		-	-

中信证券股份有限公司	2022120800000650	华润微	2022年12月8日	811,350.00	15,000	14	3.40	1,072.79	-	-
中信证券股份有限公司	2022120800013181	安克创新	2022年12月8日	307,200.00	5,000	14	3.40	406.19	-	-
中信证券股份有限公司	2022121900023594	扬杰科技	2022年12月19日	369,590.00	6,500	14	3.40	418.92	341,900.00	418.92
中信证券股份有限公司	2022121900023608	扬杰科技	2022年12月19日	568,600.00	10,000	14	3.40	644.40	526,000.00	644.40
中信证券股份有限公司	2022121900024028	中科创达	2022年12月19日	1,155,220.00	11,000	14	3.40	1,309.20	1,103,300.00	1,309.20
中信证券股份有限公司	2022122100019653	中科创达	2022年12月21日	1,042,900.00	10,000	14	3.40	985.00	1,003,000.00	985.00
中信证券股份有限公司	2022122100019655	安克创新	2022年12月21日	305,750.00	5,000	14	3.40	288.80	296,350.00	288.80
中信证券股份有限公司	2022122100019661	中微公司	2022年12月21日	1,042,700.00	10,000	14	3.40	984.80	980,100.00	984.80
中信证券股份有限公司	2022122200014051	安克创新	2022年12月22日	300,500.00	5,000	14	3.40	255.42	296,350.00	255.42
中信证券股份有限公司	2022122200015269	中际旭创	2022年12月22日	664,500.00	25,000	14	3.40	564.84	675,750.00	564.84
中信证券股份有限公司	2022122200015447	华润微	2022年12月22日	804,750.00	15,000	14	3.40	684.00	789,750.00	684.00
上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券股份有限公司	2021082000000710	华宇软件	2021年8月20日	717,500.00	41,000	14	3.40	948.69	-	-
中信证券股	202108	华润微	2021年	1,108,71	12,700	14	3.40	1,465.	-	-

份有限公司	200000 0708		8月20日	0.00					96		
中信证券股 份有限公司	202108 200000 0678	卓胜微	2021年 8月20日	2,095,05 0.00	5,000	14	3.40	2,770. 12		-	-
中信证券股 份有限公司	202108 200000 0674	安克创 新	2021年 8月20日	270,894. 00	2,300	14	3.40	358.18		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 030000 9169	华宇软 件	2021年 9月3日	450,180. 00	41,000	14	3.40	595.24		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 030000 9167	安克创 新	2021年 9月3日	257,738. 00	2,300	14	3.40	340.79		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 030000 9165	华润微	2021年 9月3日	937,641. 00	12,700	14	3.40	1,239. 77		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 030000 9163	卓胜微	2021年 9月3日	1,798,00 0.00	5,000	14	3.40	2,377. 36		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 060000 0459	欣旺达	2021年 9月6日	1,780,00 0.00	50,000	14	3.40	2,689. 78		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 060000 0457	同花顺	2021年 9月6日	1,260,40 0.00	10,000	14	3.40	1,904. 61		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 170000 7689	华宇软 件	2021年 9月17日	487,900. 00	41,000	14	3.40	967.67		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 170000 7687	卓胜微	2021年 9月17日	1,655,05 0.00	5,000	14	3.40	3,282. 51		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 170000 7685	安克创 新	2021年 9月17日	228,183. 00	2,300	14	3.40	452.56		-	-
中信证券股 份有限公司	202109 170000 7683	华润微	2021年 9月17日	878,840. 00	12,700	14	3.40	1,743. 03		-	-
中信证券股 份有限公司	202110 080007 2183	华宇软 件	2021年 10月8日	485,030. 00	41,000	14	3.40	641.32		-	-
中信证券股 份有限公司	202110 080007 2181	华润微	2021年 10月8日	885,571. 00	12,700	14	3.40	1,170. 92		-	-

中信证券股份有限公司	2021100800072179	安克创新	2021年10月8日	247,664.00	2,300	14	3.40	327.47	-	-
中信证券股份有限公司	2021100800072177	卓胜微	2021年10月8日	1,793,900.00	5,000	14	3.40	2,371.93	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000685	信维通信	2021年10月12日	1,086,170.00	47,000	14	3.40	1,436.16	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000682	同花顺	2021年10月12日	1,174,800.00	10,000	14	3.40	1,553.35	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000681	长盈精密	2021年10月12日	507,850.00	35,000	14	3.40	671.49	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000679	欣旺达	2021年10月12日	2,039,580.00	54,000	14	3.40	2,696.78	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000677	中科创达	2021年10月12日	1,727,040.00	14,000	14	3.40	2,283.53	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000676	三环集团	2021年10月12日	1,985,910.00	53,000	14	3.40	2,625.81	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000672	华大基因	2021年10月12日	873,700.00	10,000	14	3.40	1,155.23	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000671	卫宁健康	2021年10月12日	1,170,960.00	84,000	14	3.40	1,548.27	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000670	亿联网络	2021年10月12日	578,900.00	7,000	14	3.40	765.43	-	-
中信证券股份有限公司	2021101200000668	卓胜微	2021年10月12日	1,792,740.00	6,000	14	3.40	2,370.40	-	-
中信证券股份有限公司	2021102200052118	卓胜微	2021年10月22日	1,649,600.00	5,000	14	3.40	2,181.14	-	-
中信证券股份有限公司	2021102200052116	华宇软件	2021年10月22日	445,260.00	41,000	14	3.40	588.73	-	-
中信证券股份有限公司	202110220005	安克创新	2021年10月22日	240,534.00	2,300	14	3.40	318.04	-	-



	2114		日								
中信证券股 份有限公司	202110 220005 2110	华润微	2021年 10月22 日	877,189. 00	12,700	14	3.40	1,159. 84	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0508	同花顺	2021年 10月27 日	334,260. 00	3,000	14	3.40	441.97	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0506	长盈精 密	2021年 10月27 日	152,900. 00	11,000	14	3.40	202.17	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0504	三环集 团	2021年 10月27 日	670,140. 00	17,000	14	3.40	886.07	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0500	中科创 达	2021年 10月27 日	492,360. 00	4,000	14	3.40	651.01	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0499	亿联网 络	2021年 10月27 日	154,060. 00	2,000	14	3.40	203.70	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0498	信维通 信	2021年 10月27 日	366,300. 00	15,000	14	3.40	484.33	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0496	卫宁健 康	2021年 10月27 日	349,720. 00	28,000	14	3.40	462.41	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0493	卓胜微	2021年 10月27 日	637,760. 00	2,000	14	3.40	843.26	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0492	欣旺达	2021年 10月27 日	883,260. 00	18,000	14	3.40	1,167. 87	-	-	
中信证券股 份有限公司	202110 270000 0490	华大基 因	2021年 10月27 日	251,610. 00	3,000	14	3.40	332.68	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 020000 0189	长盈精 密	2021年 11月2 日	180,840. 00	12,000	14	3.40	239.11	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 020000 0187	欣旺达	2021年 11月2 日	856,620. 00	18,000	14	3.40	1,132. 64	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 020000 0184	卫宁健 康	2021年 11月2 日	364,000. 00	28,000	14	3.40	481.29	-	-	
中信证券股	202111	华大基	2021年	267,600.	3,000	14	3.40	353.83	-	-	

份有限公司	020000 0183	因	11月2 日	00							
中信证券股 份有限公司	202111 020000 0181	亿联网 络	2021年 11月2 日	157,480. 00	2,000	14	3.40	208.22	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 050006 4765	华宇软 件	2021年 11月5 日	473,140. 00	41,000	14	3.40	625.60	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 050006 4763	卓胜微	2021年 11月5 日	1,569,55 0.00	5,000	14	3.40	2,075. 29	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 050006 4761	安克创 新	2021年 11月5 日	212,520. 00	2,300	14	3.40	281.00	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 050006 4759	华润微	2021年 11月5 日	850,138. 00	12,700	14	3.40	1,124. 07	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 9209	中科创 达	2021年 11月10 日	550,360. 00	4,000	14	3.40	727.70	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 9207	卫宁健 康	2021年 11月10 日	396,480. 00	28,000	14	3.40	524.23	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 9205	亿联网 络	2021年 11月10 日	153,920. 00	2,000	14	3.40	203.52	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 9203	华大基 因	2021年 11月10 日	268,170. 00	3,000	14	3.40	354.58	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 9201	卓胜微	2021年 11月10 日	602,980. 00	2,000	14	3.40	797.27	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 7335	欣旺达	2021年 11月10 日	958,860. 00	18,000	14	3.40	1,267. 83	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 7333	同花顺	2021年 11月10 日	340,440. 00	3,000	14	3.40	450.14	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 7331	信维通 信	2021年 11月10 日	378,000. 00	15,000	14	3.40	499.80	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 100001 7329	长盈精 密	2021年 11月10 日	172,920. 00	11,000	14	3.40	228.64	-	-	

中信证券股份有限公司	2021111000017327	三环集团	2021年11月10日	722,670.00	17,000	14	3.40	955.53	-	-
中信证券股份有限公司	2021111600004934	卫宁健康	2021年11月16日	376,880.00	28,000	14	3.40	498.32	-	-
中信证券股份有限公司	2021111600004932	华大基因	2021年11月16日	278,970.00	3,000	14	3.40	368.86	-	-
中信证券股份有限公司	2021111600004930	欣旺达	2021年11月16日	898,740.00	18,000	14	3.40	1,188.33	-	-
中信证券股份有限公司	2021111600004928	亿联网络	2021年11月16日	157,700.00	2,000	14	3.40	208.51	-	-
中信证券股份有限公司	2021111600004926	长盈精密	2021年11月16日	202,080.00	12,000	14	3.40	267.19	-	-
中信证券股份有限公司	2021111900040497	华宇软件	2021年11月19日	474,370.00	41,000	14	3.40	627.22	-	-
中信证券股份有限公司	2021111900040495	卓胜微	2021年11月19日	1,501,800.00	5,000	14	3.40	1,985.71	-	-
中信证券股份有限公司	2021111900040493	安克创新	2021年11月19日	231,909.00	2,300	14	3.40	306.64	-	-
中信证券股份有限公司	2021112400016389	三环集团	2021年11月24日	723,690.00	17,000	14	3.40	956.88	-	-
中信证券股份有限公司	2021112400016387	华大基因	2021年11月24日	268,950.00	3,000	14	3.40	355.61	-	-
中信证券股份有限公司	2021112400016385	中科创达	2021年11月24日	600,680.00	4,000	14	3.40	794.23	-	-
中信证券股份有限公司	2021112400016383	卓胜微	2021年11月24日	677,820.00	2,000	14	3.40	896.23	-	-
中信证券股份有限公司	2021112400016381	信维通信	2021年11月24日	397,050.00	15,000	14	3.40	524.99	-	-
中信证券股份有限公司	202111240001	同花顺	2021年11月24日	366,960.00	3,000	14	3.40	485.20	-	-

	6379		日								
中信证券股 份有限公司	202111 240001 6377	亿联网 络	2021年 11月24 日	159,580. 00	2,000	14	3.40	211.00	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 240001 6375	长盈精 密	2021年 11月24 日	183,810. 00	11,000	14	3.40	243.04	-	-	
中信证券股 份有限公司	202111 240001 6373	卫宁健 康	2021年 11月24 日	422,800. 00	28,000	14	3.40	559.04	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 030001 7769	安克创 新	2021年 12月3 日	246,100. 00	2,300	14	3.40	325.40	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 080000 6574	同花顺	2021年 12月8 日	388,860. 00	3,000	14	3.40	514.16	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 080000 6572	信维通 信	2021年 12月8 日	371,400. 00	15,000	14	3.40	491.07	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 080000 6570	卫宁健 康	2021年 12月8 日	426,440. 00	28,000	14	3.40	563.85	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 080000 6568	三环集 团	2021年 12月8 日	762,620. 00	17,000	14	3.40	1,008. 35	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 080000 6566	亿联网 络	2021年 12月8 日	171,660. 00	2,000	14	3.40	226.97	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 080000 6564	中科创 达	2021年 12月8 日	593,360. 00	4,000	14	3.40	784.55	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 170000 2426	龙腾光 电	2021年 12月17 日	88,010.0 0	13,000	14	4.00	136.90	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 170000 2424	华宇软 件	2021年 12月17 日	211,200. 00	16,500	14	3.40	279.25	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 170000 2422	北京君 正	2021年 12月17 日	441,525. 00	3,500	14	3.40	583.79	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 170000 2420	中科创 达	2021年 12月17 日	661,455. 00	4,500	14	3.40	874.59	-	-	
中信证券股	202112	安克创	2021年	211,940.	2,000	14	3.40	280.23	-	-	

份有限公司	170000 2418	新	12月17 日	00							
中信证券股 份有限公司	202112 170002 7034	安克创 新	2021年 12月17 日	243,731. 00	2,300	14	3.40	322.27	-	-	
中信证券股 份有限公司	202112 220001 2012	信维通 信	2021年 12月22 日	387,300. 00	15,000	14	3.40	329.22	379,80 0.00	329.22	
中信证券股 份有限公司	202112 220001 2010	同花顺	2021年 12月22 日	430,590. 00	3,000	14	3.40	366.03	433,74 0.00	366.03	
中信证券股 份有限公司	202112 220001 2008	卫宁健 康	2021年 12月22 日	432,040. 00	28,000	14	3.40	367.20	469,28 0.00	367.20	
中信证券股 份有限公司	202112 220001 2006	三环集 团	2021年 12月22 日	768,570. 00	17,000	14	3.40	653.31	758,20 0.00	653.31	
中信证券股 份有限公司	202112 220001 2004	中科创 达	2021年 12月22 日	601,120. 00	4,000	14	3.40	510.93	553,68 0.00	510.93	
中信证券股 份有限公司	202112 220001 1462	亿联网 络	2021年 12月22 日	161,640. 00	2,000	14	3.40	137.43	162,90 0.00	137.43	
中信证券股 份有限公司	202112 310000 0466	中芯国 际	2021年 12月31 日	529,900. 00	10,000	14	4.00	-	529,90 0.00	-	
中信证券股 份有限公司	202112 310000 0464	华宇软 件	2021年 12月31 日	203,200. 00	16,000	14	3.80	-	203,20 0.00	-	
中信证券股 份有限公司	202112 310000 0461	北京君 正	2021年 12月31 日	536,000. 00	4,000	14	3.80	-	536,00 0.00	-	
中信证券股 份有限公司	202112 310000 0460	三环集 团	2021年 12月31 日	446,000. 00	10,000	14	3.80	-	446,00 0.00	-	
中信证券股 份有限公司	202112 310002 7332	北京君 正	2021年 12月31 日	469,000. 00	3,500	14	3.40	-	469,00 0.00	-	
中信证券股 份有限公司	202112 310002 7330	中科创 达	2021年 12月31 日	622,890. 00	4,500	14	3.40	-	622,89 0.00	-	
中信证券股 份有限公司	202112 310002 7328	华宇软 件	2021年 12月31 日	209,550. 00	16,500	14	3.40	-	209,55 0.00	-	

中信证券股份有限公司	2021123100027326	安克创新	2021年12月31日	235,750.00	2,300	14	3.40	-	235,750.00	-
中信证券股份有限公司	2021123100027324	龙腾光电	2021年12月31日	89,050.00	13,000	14	4.00	-	89,050.00	-
中信证券股份有限公司	2021123100027322	安克创新	2021年12月31日	205,000.00	2,000	14	3.40	-	205,000.00	-

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
中信证券股份有限公司	4,398,801.00	0.52	5,006,701.00	0.60
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	31,765,100.00	3.74	25,383,200.00	3.06

##### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司	4,948,452.47	130,208.03	7,751,821.62	501,658.90

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末(2022 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000063	中兴通讯	2023 年 1 月 3 日	25.86	16,600	429,276.00
2	002036	联创电子	2023 年 1 月 11 日	12.37	66,500	822,605.00
3	002049	紫光国微	2023 年 1 月 30 日	131.82	13,500	1,779,570.00
4	002152	广电运通	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 13 日	9.94	80,600	801,164.00
5	002156	通富微电	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	16.48	57,000	939,360.00
6	002180	纳思达	2023 年 1 月 12 日	51.89	44,400	2,303,916.00
7	002230	科大讯飞	2023 年 1 月 3 日	32.83	12,300	403,809.00
8	002241	歌尔股份	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	16.83	94,800	1,595,484.00
9	002600	领益智造	2023 年 1 月 11 日	4.54	170,000	771,800.00
10	002821	凯莱英	2023 年 1 月 13 日	148.00	10,000	1,480,000.00
11	002841	视源股	2023 年 1 月 3 日-2023 年	59.04	22,600	1,334,304

		份	1月11日			.00
12	002916	深南电路	2023年1月3日	72.15	10,000	721,500.00
13	002920	德赛西威	2023年1月9日	105.34	10,000	1,053,400.00
14	002938	鹏鼎控股	2023年1月3日	27.44	42,000	1,152,480.00
15	300308	中际旭创	2023年1月5日	27.03	36,000	973,080.00
16	300373	扬杰科技	2023年1月3日	52.60	16,500	867,900.00
17	300496	中科创达	2023年1月3日-2023年1月4日	100.30	21,000	2,106,300.00
18	300682	朗新科技	2023年1月3日-2023年1月11日	21.98	31,000	681,380.00
19	300760	迈瑞医疗	2023年1月3日	315.97	1,000	315,970.00
20	300866	安克创新	2023年1月4日-2023年1月5日	59.27	10,000	592,700.00
21	600460	士兰微	2023年1月9日-2023年1月13日	32.79	52,000	1,705,080.00
22	600536	中国软件	2023年1月3日-2023年1月5日	58.33	24,000	1,399,920.00
23	600570	恒生电子	2023年1月4日-2023年1月30日	40.46	21,700	877,982.00
24	600588	用友网络	2023年1月3日-2023年1月12日	24.17	43,600	1,053,812.00
25	600745	闻泰科技	2023年1月3日	52.58	47,000	2,471,260.00
26	600845	宝信软件	2023年1月3日	44.80	26,000	1,164,800.00
27	601360	三六零	2023年1月3日	6.54	180,000	1,177,200.00
28	603019	中科曙光	2023年1月3日-2023年1月13日	22.14	70,000	1,549,800.00
29	603501	韦尔股份	2023年1月13日	77.09	10,000	770,900.00
30	603986	兆易创新	2023年1月12日	102.47	10,000	1,024,700.00
31	688008	澜起科技	2023年1月3日-2023年1月11日	62.60	52,000	3,255,200.00
32	688012	中微公司	2023年1月4日	98.01	10,000	980,100.00
33	688099	晶晨股	2023年1月3日	70.51	15,000	1,057,650.00



		份				.00
34	688396	华润微	2023 年 1 月 5 日	52.65	15,000	789,750.00
合计	-	-	-	-	1,342,100	40,404,152.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、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、法律合规部和内控稽核部是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查等，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

同时，公司董事会确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对重大事件、重大决策的风险评估意见和风险管理报告进行审议，审批重大风险的解决方案；公司管理层根据董事会的风险管理战略，制定并确保公司风险管理制度得以全面、有效执行，在董事会授权范围内批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案，组织各业务部门开展风险管控工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

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

无。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

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

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	4,948,452.47	-	-	-	4,948,452.47
结算备付金	174,121.97	-	-	-	174,121.97
存出保证金	97,171.35	-	-	-	97,171.35
交易性金融资产	-	-	-	-502,247,325.06	502,247,325.06
其他资产	-	-	-	21,096.07	21,096.07
资产总计	5,219,745.79	-	-	-502,268,421.13	507,488,166.92
负债					
应付清算款	-	-	-	153.89	153.89
应付管理人报酬	-	-	-	196,942.87	196,942.87
应付托管费	-	-	-	30,635.59	30,635.59
应交税费	-	-	-	2,750.31	2,750.31
其他负债	-	-	-	665,742.43	665,742.43
负债总计	-	-	-	896,225.09	896,225.09
利率敏感度缺口	5,219,745.79	-	-	-501,372,196.04	506,591,941.83
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	7,751,821.62	-	-	-	7,751,821.62
结算备付金	488,904.18	-	-	-	488,904.18
存出保证金	186,617.97	-	-	-	186,617.97
交易性金融资产	-	-	-	-746,121,591.22	746,121,591.22
应收清算款	-	-	-	99,101.52	99,101.52
其他资产	-	-	-	11,773.50	11,773.50
资产总计	8,427,343.77	-	-	-746,232,466.24	754,659,810.01
负债					
应付清算款	-	-	-	651.43	651.43
应付管理人报酬	-	-	-	292,209.84	292,209.84
应付托管费	-	-	-	45,454.91	45,454.91
应交税费	-	-	-	1,495.19	1,495.19
其他负债	-	-	-	714,244.50	714,244.50
负债总计	-	-	-	1,054,055.87	1,054,055.87
利率敏感度缺口	8,427,343.77	-	-	-745,178,410.37	753,605,754.14

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	502,247,325.06	99.14	746,121,591.22	99.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	502,247,325.06	99.14	746,121,591.22	99.01

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

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准增加	24,968,631.16	34,931,195.69

	5%		
	业绩比较基准减少	-24,968,631.16	-34,931,195.69
	5%		

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	502,247,325.06	746,116,086.73
第二层次	-	5,504.49
第三层次	-	-
合计	502,247,325.06	746,121,591.22

###### 7.4.14.2.2 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。

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

**7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况****7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

无。

**7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况**

无。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：同）。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	502,247,325.06	98.97
	其中：股票	502,247,325.06	98.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,122,574.44	1.01
8	其他各项资产	118,267.42	0.02
9	合计	507,488,166.92	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 40,404,152.00 元，占期末资产净值比例为 7.98%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	366,630,571.91	72.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,774,269.23	17.92
J	金融业	5,038,971.00	0.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	39,722,400.00	7.84
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	502,166,212.14	99.13

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	81,112.92	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-



F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,112.92	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。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	1,067,145	41,117,096.85	8.12
2	603259	药明康德	490,400	39,722,400.00	7.84
3	002475	立讯精密	1,187,900	37,715,825.00	7.45
4	300760	迈瑞医疗	116,200	36,715,714.00	7.25
5	002049	紫光国微	162,380	21,404,931.60	4.23
6	000063	中兴通讯	761,301	19,687,243.86	3.89
7	603986	兆易创新	159,385	16,332,180.95	3.22
8	300142	沃森生物	382,500	15,372,675.00	3.03
9	600570	恒生电子	363,544	14,708,990.24	2.90
10	002230	科大讯飞	444,600	14,596,218.00	2.88
11	002371	北方华创	63,000	14,193,900.00	2.80
12	002410	广联达	227,600	13,644,620.00	2.69
13	603501	韦尔股份	169,855	13,094,121.95	2.58

14	600588	用友网络	492,337	11,899,785.29	2.35
15	688008	澜起科技	189,878	11,886,362.80	2.35
16	002180	纳思达	203,400	10,554,426.00	2.08
17	688012	中微公司	103,285	10,122,962.85	2.00
18	002241	歌尔股份	571,400	9,616,662.00	1.90
19	600745	闻泰科技	178,800	9,401,304.00	1.86
20	300496	中科创达	76,500	7,672,950.00	1.51
21	002821	凯莱英	48,746	7,214,408.00	1.42
22	002920	德赛西威	66,200	6,973,508.00	1.38
23	600460	士兰微	203,500	6,672,765.00	1.32
24	688396	华润微	125,849	6,625,949.85	1.31
25	600845	宝信软件	140,584	6,298,163.20	1.24
26	603019	中科曙光	280,300	6,205,842.00	1.23
27	600536	中国软件	94,740	5,526,184.20	1.09
28	603392	万泰生物	42,915	5,437,330.50	1.07
29	300628	亿联网络	86,200	5,222,858.00	1.03
30	300033	同花顺	51,100	5,038,971.00	0.99
31	002841	视源股份	83,100	4,906,224.00	0.97
32	688099	晶晨股份	69,030	4,867,305.30	0.96
33	002938	鹏鼎控股	166,400	4,566,016.00	0.90
34	601360	三六零	683,500	4,470,090.00	0.88
35	002268	卫士通	141,300	4,313,889.00	0.85
36	300223	北京君正	57,300	4,036,212.00	0.80
37	300136	信维通信	230,900	3,812,159.00	0.75
38	002463	沪电股份	317,400	3,777,060.00	0.75
39	300308	中际旭创	133,700	3,613,911.00	0.71
40	002156	通富微电	216,700	3,571,216.00	0.70
41	002916	深南电路	48,700	3,513,705.00	0.69
42	603236	移远通信	31,935	3,219,686.70	0.64
43	300373	扬杰科技	61,000	3,208,600.00	0.63
44	002036	联创电子	256,700	3,175,379.00	0.63
45	002600	领益智造	672,600	3,053,604.00	0.60
46	002152	广电运通	296,300	2,945,222.00	0.58
47	300866	安克创新	48,300	2,862,741.00	0.57
48	300682	朗新科技	126,300	2,776,074.00	0.55
49	601231	环旭电子	158,000	2,564,340.00	0.51
50	600498	烽火通信	170,200	2,236,428.00	0.44

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
2	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	44,881,373.68	5.96
2	603259	药明康德	39,619,342.00	5.26
3	300760	迈瑞医疗	38,599,331.60	5.12
4	002371	北方华创	15,646,505.30	2.08
5	300142	沃森生物	15,576,958.83	2.07
6	000661	长春高新	15,420,251.41	2.05
7	002410	广联达	13,550,685.28	1.80
8	688008	澜起科技	13,320,789.07	1.77
9	688012	中微公司	12,787,284.73	1.70
10	600745	闻泰科技	11,948,700.52	1.59
11	002180	纳思达	10,769,339.68	1.43
12	002415	海康威视	8,726,321.05	1.16
13	600584	长电科技	8,128,174.29	1.08
14	300390	天华超净	8,111,577.00	1.08
15	603019	中科曙光	7,738,391.00	1.03
16	002049	紫光国微	6,532,905.20	0.87
17	300033	同花顺	6,006,103.82	0.80
18	002463	沪电股份	5,813,549.00	0.77
19	002916	深南电路	5,523,805.00	0.73
20	002938	鹏鼎控股	5,471,808.00	0.73

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

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	51,144,011.20	6.79
2	000725	京东方 A	31,593,652.00	4.19
3	688981	中芯国际	22,972,413.45	3.05
4	300122	智飞生物	20,728,782.00	2.75
5	000100	TCL 科技	17,050,479.00	2.26
6	000661	长春高新	15,762,738.00	2.09
7	600703	三安光电	14,673,803.40	1.95
8	300782	卓胜微	14,246,876.86	1.89
9	600196	复星医药	13,595,464.51	1.80
10	688111	金山办公	12,019,328.45	1.59
11	300408	三环集团	11,758,656.75	1.56

12	600584	长电科技	8,253,228.82	1.10
13	600487	亨通光电	7,737,808.00	1.03
14	300390	天华超净	6,821,866.00	0.91
15	002241	歌尔股份	6,554,872.00	0.87
16	000063	中兴通讯	6,045,372.00	0.80
17	002049	紫光国微	5,949,573.76	0.79
18	000066	中国长城	5,907,587.00	0.78
19	300033	同花顺	5,803,650.54	0.77
20	002185	华天科技	5,632,049.00	0.75

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

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	382,966,065.53
卖出股票收入（成交）总额	363,594,786.27

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,171.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	21,096.07
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,267.42

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002049	紫光国微	1,779,570.00	0.35	转融通流通受限
2	603986	兆易创新	1,024,700.00	0.20	转融通流通受限
3	600570	恒生电子	877,982.00	0.17	转融通流通受限
4	000063	中兴通讯	429,276.00	0.08	转融通流通受限
5	002230	科大讯飞	403,809.00	0.08	转融通流通受限
6	300760	迈瑞医疗	315,970.00	0.06	转融通流通受限

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
14,654	57,883.72	117,619,095.00	13.87	730,608,905.00	86.13

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“工银瑞信中证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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中信证券股份有限公司-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	31,765,100.00	3.74

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	13,980,800.00	1.65
2	广发证券股份有限公司	11,837,900.00	1.40
3	都邦财产保险股份有限公司	10,600,000.00	1.25
4	中信建投证券股份有限公司	8,048,495.00	0.95
5	申万宏源证券有限公司	7,738,499.00	0.91
6	仇光峰	5,185,100.00	0.61
7	长江证券股份有限公司	5,170,200.00	0.61
8	山东天泽石油科技有限公司	5,000,000.00	0.59
9	宁波珑琪投资管理合伙企业(有限合伙)	5,000,000.00	0.59
10	中信证券股份有限公司	4,398,801.00	0.52
11	中信证券股份有限公司	31,765,100.00	3.74

	司-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		
--	-----------------------------------	--	--

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年1月21日）基金份额总额	1,224,228,000.00
本报告期期初基金份额总额	830,228,000.00
本报告期基金总申购份额	169,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	151,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	848,228,000.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人

基金管理人于2022年8月18日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，王建先生自2022年8月17日起担任公司首席信息官。

基金管理人于2022年10月20日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，许长勇先生自2022年10月18日起担任公司副总经理，马成先生自2022年10月18日起不再担任公司副总经理。

**2、基金托管人**

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**11.4 基金投资策略的改变**

本报告期内基金投资策略未有改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 65,000.00 元，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

无。

**11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

无。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	4	746,062,178.69	100.00	537,774.17	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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于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旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定的媒介	2022年6月17日
3	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022年8月18日
4	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022年10月20日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2023年3月30日