

工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强 型证券投资基金 2022 年年度报告

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生银行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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73
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	73
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	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金	
基金简称	工银中证 500 六个月持有指数增强	
基金主代码	014133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 14 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	284,538,126.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014133	014134
报告期末下属分级基金的份额总额	182,976,008.34 份	101,562,117.97 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	罗菲菲
	联系电话	400-811-9999	010-58560666
	电子邮箱	customerservice@icbcs.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	95568

传真	010-66583158	010-57093382
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	赵桂才	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年 12 月 14 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日	
	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
本期已实现收益	-22,359,836.51	-13,404,487.95	-831,447.27	-502,568.78
本期利润	-29,825,772.99	-17,328,676.80	1,610,649.34	903,704.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1427	-0.1466	0.0073	0.0071
本期加权平均净值利润率	-16.12%	-16.60%	0.73%	0.71%
本期基金份额净值增长率	-13.79%	-14.14%	0.73%	0.71%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-24,086,023.28	-13,737,913.87	-831,503.25	-502,596.89

期末可供分配基金份额利润	-0.1316	-0.1353	-0.0037	-0.0039
期末基金资产净值	158,889,985.06	87,824,204.10	223,762,471.21	128,858,810.30
期末基金份额净值	0.8684	0.8647	1.0073	1.0071
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	-13.16%	-13.53%	0.73%	0.71%

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

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银中证 500 六个月持有指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.83%	0.93%	2.52%	0.97%	1.31%	-0.04%
过去六个月	-5.26%	1.03%	-8.66%	1.04%	3.40%	-0.01%
过去一年	-13.79%	1.28%	-19.30%	1.31%	5.51%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-13.16%	1.25%	-19.23%	1.28%	6.07%	-0.03%

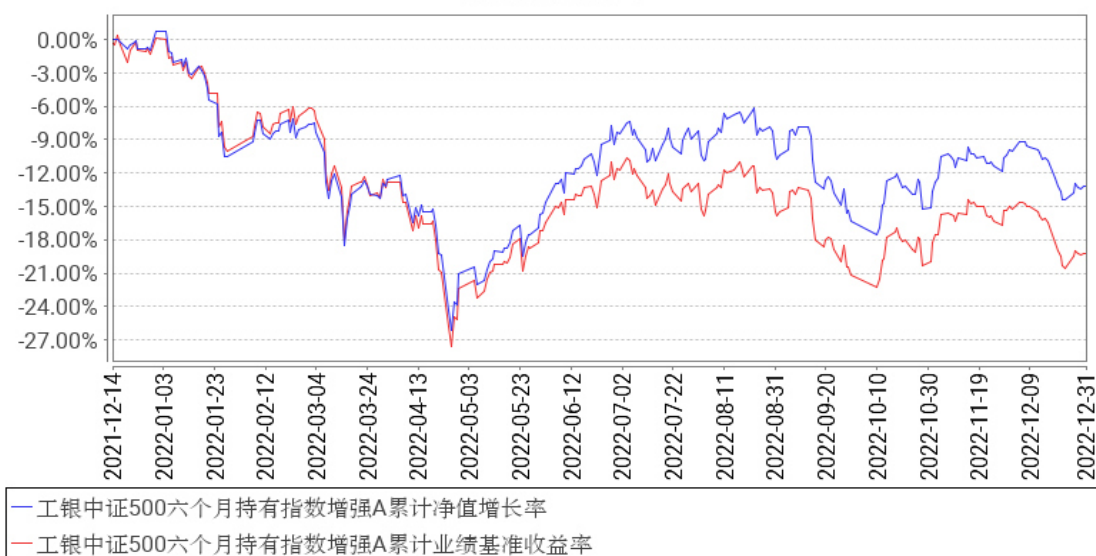
工银中证 500 六个月持有指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.72%	0.93%	2.52%	0.97%	1.20%	-0.04%

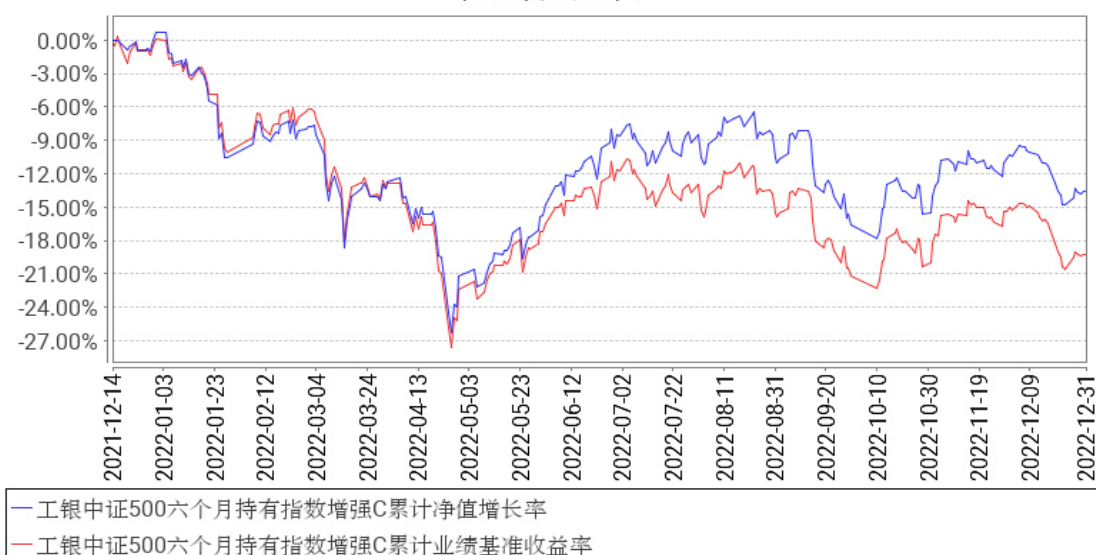
过去六个月	-5.46%	1.03%	-8.66%	1.04%	3.20%	-0.01%
过去一年	-14.14%	1.28%	-19.30%	1.31%	5.16%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	-13.53%	1.25%	-19.23%	1.28%	5.70%	-0.03%

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

工银中证500六个月持有指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



工银中证500六个月持有指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

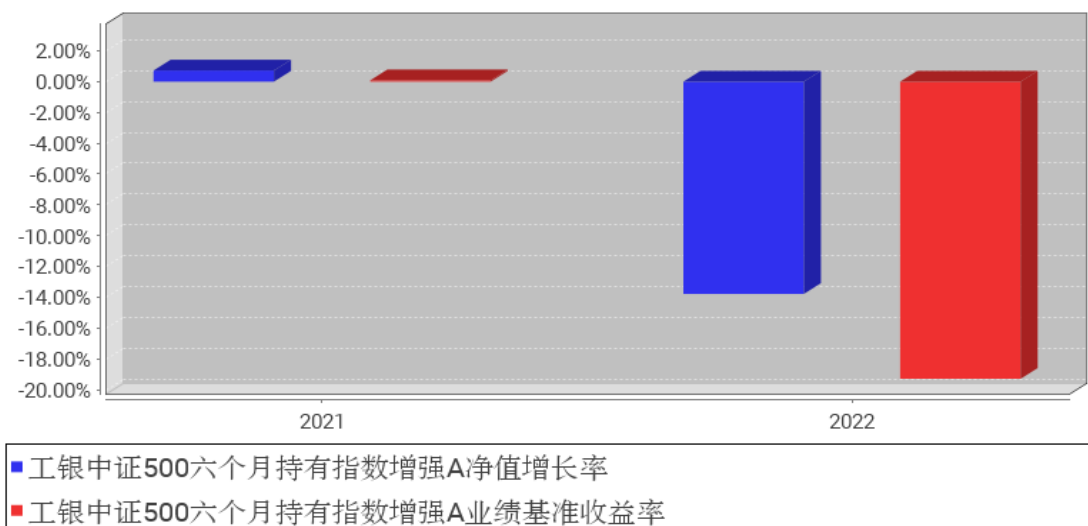


注：1、本基金基金合同于 2021 年 12 月 14 日生效。

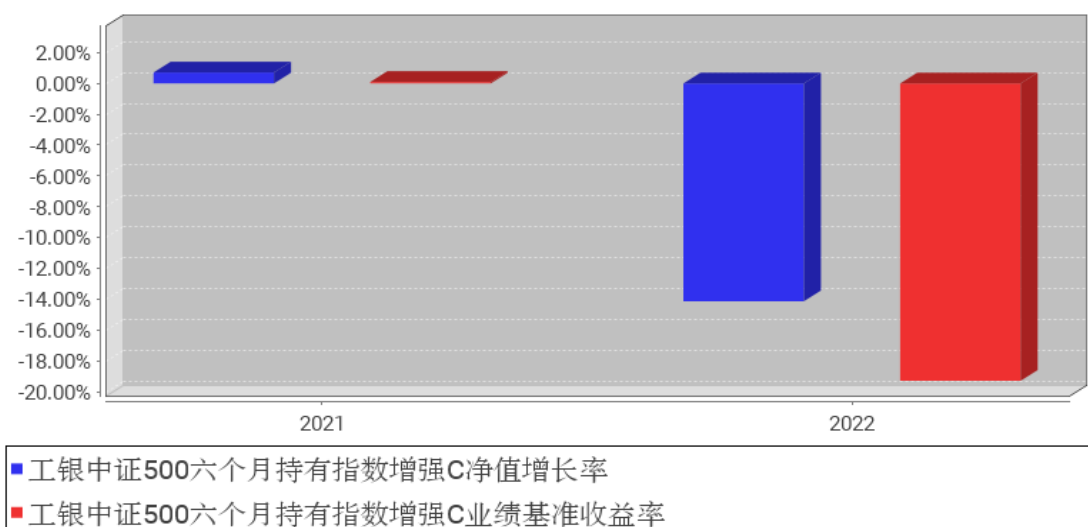
2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

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

工银中证500六个月持有指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



工银中证500六个月持有指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 14 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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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。
邓皓友	本基金的基金经理	2021 年 12 月 14 日	-	8 年	硕士。曾在瀚华金控股份有限公司担任数据分析师。2014 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2019 年 10 月 29 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 29 日至今，担任工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证消费服务领先交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 24 日至今，担任工银瑞信大和日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 180ESG 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募

说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。中证 500 指数成份股由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

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%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-13.79%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为-19.30%，本基金 C 份额净值增长率为-14.14%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-19.30%。

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。

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，日常监控投资管理机构的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务

流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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	安永华明（2023）审字第 60802052_A104 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不

	<p>对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>（1）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>（2）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>（3）评价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>（4）对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，就可能导致对工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p>

	(5) 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。我们与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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蒋燕华	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
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 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	14,766,787.28	33,391,005.01
结算备付金		10,372.15	6,878,421.62
存出保证金		-	2,250,186.40
交易性金融资产	7.4.7.2	232,628,967.29	310,230,318.41
其中：股票投资		232,628,967.29	310,230,318.41
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		819.26	22,058.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	51,551.64
资产总计		247,406,945.98	352,823,541.41

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		255,116.26	-
应付管理人报酬		215,441.46	162,303.59
应付托管费		21,544.16	16,230.35
应付销售服务费		30,654.93	23,725.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	170,000.00	-
负债合计		692,756.82	202,259.90
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	284,538,126.31	350,106,941.96
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-37,823,937.15	2,514,339.55
净资产合计		246,714,189.16	352,621,281.51
负债和净资产总计		247,406,945.98	352,823,541.41

注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 14 日，上年度可比期间财务报表的实际编制期间系 2021 年 12 月 14 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，基金份额总额为 284,538,126.31 份，其中工银中证 500 六个月持有指数增强 A 基金份额总额为 182,976,008.34 份，基金份额净值 0.8684 元；工银中证 500 六个月持有指数增强 C 基金份额总额为 101,562,117.97 份，基金份额净值 0.8647 元。

3、比较数据已根据《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示，下同。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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 12 月 14 日（基 金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
-----	-----	---	---

一、营业总收入		-43,371,055.39	3,382,054.61
1. 利息收入		303,719.90	126,769.61
其中：存款利息收入	7.4.7.13	303,719.90	123,963.63
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		-	2,805.98
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-32,284,649.96	-593,084.63
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-37,628,104.99	-553,610.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	383,789.76	-
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	1,050,480.85	-39,826.00
股利收益	7.4.7.19	3,909,184.42	352.00
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	-11,390,125.33	3,848,369.63
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	-	-
减：二、营业总支出		3,783,394.40	867,701.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,898,769.59	162,303.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	289,876.97	16,230.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	418,355.34	23,725.96
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		3,798.99	-
8. 其他费用	7.4.7.23	172,593.51	665,441.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,154,449.79	2,514,353.58
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,154,449.79	2,514,353.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-47,154,449.79	2,514,353.58

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，下同。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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）	350,106,941.96	-	2,514,339.55	352,621,281.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	350,106,941.96	-	2,514,339.55	352,621,281.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,568,815.65	-	-40,338,276.70	-105,907,092.35
（一）、综合收益总额	-	-	-47,154,449.79	-47,154,449.79
（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）	-65,568,815.65	-	6,816,173.09	-58,752,642.56
其中：1. 基金申购款	14,691,250.71	-	-1,723,341.44	12,967,909.27
2. 基金赎回款	-80,260,066.36	-	8,539,514.53	-71,720,551.83
（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)	284,538,126.31	-	-37,823,937.15	246,714,189.16
项目	上年度可比期间			
	2021 年 12 月 14 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)	350,084,769.61	-	-	350,084,769.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,172.35	-	2,514,339.55	2,536,511.90
(一)、综合收益总额	-	-	2,514,353.58	2,514,353.58
(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)	22,172.35	-	-14.03	22,158.32
其中: 1. 基金申购款	22,172.35	-	-14.03	22,158.32
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	350,106,941.96	-	2,514,339.55	352,621,281.51

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评

估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；
债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；
处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流

入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(2) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分

部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《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）。

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示。同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产，金额分别为 33,391,005.01 元、6,878,421.62 元、2,250,186.40 元、0.00 元、0.00 元、51,551.64 元、0.00 元、22,058.33 元、0.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、其他资产-应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 33,421,895.91 元、6,899,082.36 元、2,250,186.40 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、22,058.33 元、0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 310,230,318.41 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 310,230,318.41 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，金额分别为 0.00 元、0.00 元、0.00 元、162,303.59 元、16,230.35 元、23,725.96 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.00 元、0.00 元、0.00 元、162,303.59 元、16,230.35 元、23,725.96 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

(1) 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

（2）增值税

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

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

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

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

（5）境外投资

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

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	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,055,683.12	1,087,841.21
等于：本金	1,055,550.38	1,087,841.21
加：应计利息	132.74	-
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	13,711,104.16	32,303,163.80
等于：本金	13,705,321.20	32,303,163.80
加：应计利息	5,782.96	-
减：坏账准备	-	-
合计	14,766,787.28	33,391,005.01

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	240,170,722.99	-	232,628,967.29	-7,541,755.70
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	240,170,722.99	-	232,628,967.29	-7,541,755.70
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	306,496,814.78	-	310,230,318.41	3,733,503.63
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	306,496,814.78	-	310,230,318.41	3,733,503.63

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	15,957,894.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	15,957,894.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	15,957,894.00	-	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于本报告期末所有的股指期货合约产生的持仓损益金额。因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。

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	-	51,551.64
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	51,551.64

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	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	50,000.00	-
预提信息披露费	120,000.00	-
合计	170,000.00	-

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银中证 500 六个月持有指数增强 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	222,151,830.80	222,151,830.80
本期申购	6,800,817.50	6,800,817.50
本期赎回（以“-”号填列）	-45,976,639.96	-45,976,639.96
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	182,976,008.34	182,976,008.34

工银中证 500 六个月持有指数增强 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,955,111.16	127,955,111.16
本期申购	7,890,433.21	7,890,433.21
本期赎回（以“-”号填列）	-34,283,426.40	-34,283,426.40
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	101,562,117.97	101,562,117.97

注：1、若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2021 年 12 月 14 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 350,084,769.61

份基金份额，其中认购资金利息折合 94,811.21 份基金份额。

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

工银中证 500 六个月持有指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-831,503.25	2,442,143.66	1,610,640.41
本期利润	-22,359,836.51	-7,465,936.48	-29,825,772.99
本期基金份额交易产生的变动数	4,350,786.90	-221,677.60	4,129,109.30
其中：基金申购款	-546,727.03	-200,595.50	-747,322.53
基金赎回款	4,897,513.93	-21,082.10	4,876,431.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,840,552.86	-5,245,470.42	-24,086,023.28

工银中证 500 六个月持有指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-502,596.89	1,406,296.03	903,699.14
本期利润	-13,404,487.95	-3,924,188.85	-17,328,676.80
本期基金份额交易产生的变动数	3,078,891.93	-391,828.14	2,687,063.79
其中：基金申购款	-772,687.03	-203,331.88	-976,018.91
基金赎回款	3,851,578.96	-188,496.26	3,663,082.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,828,192.91	-2,909,720.96	-13,737,913.87

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,431.29	3,071.28
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	276,414.02	45,531.61
结算备付金利息收入	20,874.59	75,360.74
其他	-	-
合计	303,719.90	123,963.63

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12月14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	-37,628,104.99	-553,610.63
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-37,628,104.99	-553,610.63

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12月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	3,056,470,965.10	119,159,817.37
减：卖出股票成本总额	3,085,206,065.77	119,713,428.00
减：交易费用	8,893,004.32	-
买卖股票差价收入	-37,628,104.99	-553,610.63

7.4.7.14.3 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

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12月14日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	398.96	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	383,390.80	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-

债券投资收益——申购 差价收入		
合计	383,789.76	

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年12月14日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	2,086,472.45	
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	1,702,600.00	
减：应计利息总额	404.31	
减：交易费用	77.34	
买卖债券差价收入	383,390.80	

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年12月14日(基金合同生效日)至2021年12月31日
股指期货投资收益	1,050,480.85	-39,826.00

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12月14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	3,909,184.42	352.00
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,909,184.42	352.00

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12月14日(基金合同生效日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-11,275,259.33	3,733,503.63
股票投资	-11,275,259.33	3,733,503.63
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	-114,866.00	114,866.00

权证投资	-	-
期货投资	-114,866.00	114,866.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-11,390,125.33	3,848,369.63

7.4.7.21 其他收入

无。

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12月14日(基金合同生效日)至2021年12月31日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,192.21	-
存托服务费	1.30	-
开户费	400.00	-
交易费用	-	665,441.13
合计	172,593.51	665,441.13

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理(国际)有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 12 月 14 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	2,898,769.59	162,303.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,043,154.93	51,731.14

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

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 12 月 14 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	289,876.97	16,230.35

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	5,117.97	5,117.97
中国工商银行股份有限公司	-	35,425.03	35,425.03
中国民生银行股份有限公司	-	1,778.60	1,778.60
合计	-	42,321.60	42,321.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 12 月 14 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销售服务费		
	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	248.80	248.80
中国工商银行股份有限公司	-	1,662.04	1,662.04
中国民生银行股份有限公司	-	81.62	81.62
合计	-	1,992.46	1,992.46

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年12月14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
中国民生银行股份有限公司	1,055,683.12	6,431.29	1,087,841.21	3,071.28

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)				
688428	诺诚健华	2022 年 9 月 14 日	6 个月	新股锁定	11.03	12.83	29,694	327,524.82	380,974.02		-
688293	奥浦迈	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股锁定	80.20	99.12	1,367	109,633.40	135,497.04		-
688432	有研硅	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.91	11.24	9,100	90,181.00	102,284.00		-
688362	甬矽电子	2022 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁定	18.54	19.18	4,785	88,713.90	91,776.30		-
688489	三未信安	2022 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	78.89	90.62	945	74,551.05	85,635.90		-
688459	哈铁科技	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.58	8.27	7,705	104,633.90	63,720.35		-
688370	丛麟科技	2022 年 8 月 17 日	6 个月	新股锁定	59.76	34.87	1,667	99,619.92	58,128.29		-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁定	33.65	69.68	384	12,921.60	26,757.12		-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁定	32.69	87.94	268	8,760.92	23,567.92		-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	3.82	6.01	3,525	13,465.50	21,185.25		-
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定	58.00	86.49	244	14,152.00	21,103.56		-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定	237.50	176.97	109	25,887.50	19,289.73		-
301308	江波龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新股锁定	55.67	56.72	277	15,420.59	15,711.44		-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定	119.88	175.78	85	10,189.80	14,941.30		-
301301	川宁	2022 年	6 个月	新股锁	5.00	7.53	1,984	9,920.00	14,939.52		-

	生物	12月20日		定							
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股锁定	71.17	73.04	180	12,810.60	13,147.20		-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股锁定	50.88	66.20	186	9,463.68	12,313.20		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股锁定	13.88	15.86	707	9,813.16	11,213.02		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定	30.66	37.85	292	8,952.72	11,052.20		-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	新股锁定	37.89	37.79	272	10,306.08	10,278.88		-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股锁定	43.32	31.31	309	13,385.88	9,674.79		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股锁定	96.00	80.97	119	11,424.00	9,635.43		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股锁定	63.00	43.33	221	13,923.00	9,575.93		-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股锁定	32.38	31.61	298	9,649.24	9,419.78		-
301121	紫建电子	2022年8月1日	6个月	新股锁定	61.07	49.77	189	11,542.23	9,406.53		-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定	43.23	42.29	222	9,597.06	9,388.38		-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股锁定	22.88	17.63	520	11,897.60	9,167.60		-
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股锁定	26.80	24.48	374	10,023.20	9,155.52		-

301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股锁定	18.19	14.90	608	11,059.52	9,059.20	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股锁定	52.69	51.41	175	9,220.75	8,996.75	-
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股锁定	49.98	33.82	258	12,894.84	8,725.56	-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股锁定	18.78	15.59	553	10,385.34	8,621.27	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股锁定	78.80	76.96	112	8,825.60	8,619.52	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股锁定	22.50	17.16	497	11,182.50	8,528.52	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股锁定	44.09	35.13	242	10,669.78	8,501.46	-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股锁定	51.72	36.62	222	11,481.84	8,129.64	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股锁定	26.28	18.13	443	11,642.04	8,031.59	-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股锁定	18.18	17.72	443	8,053.74	7,849.96	-
301197	工大科雅	2022年7月29日	6个月	新股锁定	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301115	建科股份	2022年8月23日	6个月	新股锁定	42.05	24.04	305	12,825.25	7,332.20	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股锁定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股锁定	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-

		日									
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股锁定	138.88	103.52	63	8,749.44	6,521.76		-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股锁定	30.38	25.25	257	7,807.66	6,489.25		-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股锁定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股锁定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股锁定	13.28	11.40	524	6,958.72	5,973.60		-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股锁定	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50		-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股锁定	40.66	22.61	242	9,839.72	5,471.62		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股锁定	64.68	41.74	123	7,955.64	5,134.02		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定	39.00	24.46	159	6,201.00	3,889.14		-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、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	14,766,787.28	-	-	-	14,766,787.28
结算备付金	10,372.15	-	-	-	10,372.15
交易性金融资产	-	-	-	-232,628,967.29	232,628,967.29
应收申购款	-	-	-	819.26	819.26
资产总计	14,777,159.43	-	-	-232,629,786.55	247,406,945.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	255,116.26	255,116.26
应付管理人报酬	-	-	-	215,441.46	215,441.46
应付托管费	-	-	-	21,544.16	21,544.16
应付销售服务费	-	-	-	30,654.93	30,654.93
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	692,756.82	692,756.82
利率敏感度缺口	14,777,159.43	-	-	-231,937,029.73	246,714,189.16
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,391,005.01	-	-	-	33,391,005.01
结算备付金	6,878,421.62	-	-	-	6,878,421.62
存出保证金	2,250,186.40	-	-	-	2,250,186.40
交易性金融资产	-	-	-	-310,230,318.41	310,230,318.41
应收申购款	-	-	-	22,058.33	22,058.33
其他资产	-	-	-	51,551.64	51,551.64
资产总计	42,519,613.03	-	-	-310,303,928.38	352,823,541.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	162,303.59	162,303.59
应付托管费	-	-	-	16,230.35	16,230.35
应付销售服务费	-	-	-	23,725.96	23,725.96
负债总计	-	-	-	202,259.90	202,259.90
利率敏感度缺口	42,519,613.03	-	-	-310,101,668.48	352,621,281.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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	232,628,967.29	94.29	310,230,318.41	87.98
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	232,628,967.29	94.29	310,230,318.41	87.98

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

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	11,942,270.38	8,867,809.31

	5%		
	业绩比较基准减少	-11,942,270.38	-8,867,809.31
	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	231,217,332.73	310,230,318.41
第二层次	-	-
第三层次	1,411,634.56	-
合计	232,628,967.29	310,230,318.41

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,390,827.54	1,390,827.54
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	20,807.02	20,807.02
其中：计入损益的利得或损失	-	20,807.02	20,807.02
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,411,634.56	1,411,634.56
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	20,807.02	20,807.02
项目	上年度可比同期 2021 年 12 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——	-	-	-

一公允价值变动损益			
-----------	--	--	--

注：本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资，计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,411,634.56	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.44%-247.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	232,628,967.29	94.03
	其中：股票	232,628,967.29	94.03
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	14,777,159.43	5.97
8	其他各项资产	819.26	0.00
9	合计	247,406,945.98	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	3,978,313.00	1.61
B	采矿业	10,097,128.00	4.09
C	制造业	121,849,246.54	49.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,620,650.70	1.06
E	建筑业	1,732,387.00	0.70
F	批发和零售业	7,134,386.00	2.89
G	交通运输、仓储和邮政业	6,687,705.86	2.71
H	住宿和餐饮业	29,760.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,065,467.09	2.86
J	金融业	22,796,179.00	9.24
K	房地产业	4,723,001.00	1.91
L	租赁和商务服务业	612,102.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	136,332.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	3,957,759.00	1.60
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	7,346,503.00	2.98
S	综合	1,991,802.00	0.81
	合计	202,758,722.19	82.18

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

8.2.2 报告期末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	84,133.00	0.03
B	采矿业	3,631,667.00	1.47
C	制造业	21,954,560.60	8.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,000.00	0.04
E	建筑业	64,735.00	0.03
F	批发和零售业	1,955,157.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	30,920.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	258,503.67	0.10
J	金融业	717,474.00	0.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	92,702.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	512,168.47	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	337,639.54	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	80,375.00	0.03
Q	卫生和社会工作	54,605.32	0.02
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	29,870,245.10	12.11

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	603658	安图生物	54,600	3,377,010.00	1.37
2	601168	西部矿业	328,100	3,346,620.00	1.36
3	600867	通化东宝	362,400	3,326,832.00	1.35

4	600298	安琪酵母	72,400	3,273,928.00	1.33
5	688116	天奈科技	42,200	3,255,308.00	1.32
6	000869	张裕 A	106,800	3,229,632.00	1.31
7	600271	航天信息	304,440	3,169,220.40	1.28
8	601098	中南传媒	317,100	3,164,658.00	1.28
9	000967	盈峰环境	694,500	3,153,030.00	1.28
10	601607	上海医药	172,900	3,082,807.00	1.25
11	000739	普洛药业	142,600	3,071,604.00	1.25
12	601128	常熟银行	399,700	3,017,735.00	1.22
13	002028	思源电气	76,200	2,912,364.00	1.18
14	000738	航发控制	113,300	2,905,012.00	1.18
15	600498	烽火通信	220,200	2,893,428.00	1.17
16	002409	雅克科技	57,000	2,871,090.00	1.16
17	600282	南钢股份	904,200	2,848,230.00	1.15
18	002384	东山精密	114,100	2,821,693.00	1.14
19	688006	杭可科技	61,311	2,683,582.47	1.09
20	002092	中泰化学	357,300	2,665,458.00	1.08
21	600517	国网英大	533,000	2,579,720.00	1.05
22	600390	五矿资本	502,100	2,550,668.00	1.03
23	601699	潞安环能	148,700	2,505,595.00	1.02
24	601717	郑煤机	213,600	2,383,776.00	0.97
25	600566	济川药业	87,400	2,379,028.00	0.96
26	002203	海亮股份	210,000	2,373,000.00	0.96
27	600350	山东高速	416,800	2,371,592.00	0.96
28	000553	安道麦 A	258,400	2,338,520.00	0.95
29	300699	光威复材	32,300	2,333,675.00	0.95
30	000932	华菱钢铁	489,800	2,302,060.00	0.93
31	600486	扬农化工	22,000	2,285,800.00	0.93
32	600549	厦门钨业	115,000	2,248,250.00	0.91
33	603218	日月股份	105,900	2,149,770.00	0.87
34	601555	东吴证券	328,000	2,141,840.00	0.87
35	002294	信立泰	64,900	2,131,965.00	0.86
36	002625	光启技术	125,100	2,129,202.00	0.86
37	603927	中科软	71,900	2,128,959.00	0.86
38	600755	厦门国贸	297,500	2,124,150.00	0.86
39	600967	内蒙一机	256,200	2,116,212.00	0.86
40	601992	金隅集团	826,700	2,099,818.00	0.85
41	600901	江苏租赁	380,400	2,084,592.00	0.84
42	601298	青岛港	371,000	2,081,310.00	0.84
43	300017	网宿科技	361,600	2,017,728.00	0.82
44	600060	海信视像	147,100	1,991,734.00	0.81
45	600380	健康元	176,400	1,991,556.00	0.81
46	600109	国金证券	226,500	1,970,550.00	0.80

47	000987	越秀资本	328,700	1,968,913.00	0.80
48	600160	巨化股份	126,500	1,962,015.00	0.80
49	002966	苏州银行	248,400	1,932,552.00	0.78
50	000581	威孚高科	107,904	1,913,137.92	0.78
51	600909	华安证券	416,600	1,912,194.00	0.78
52	600895	张江高科	166,200	1,884,708.00	0.76
53	600528	中铁工业	246,400	1,880,032.00	0.76
54	688538	和辉光电	697,500	1,869,300.00	0.76
55	688009	中国通号	375,100	1,796,729.00	0.73
56	601000	唐山港	653,200	1,789,768.00	0.73
57	601231	环旭电子	108,600	1,762,578.00	0.71
58	002299	圣农发展	73,700	1,745,953.00	0.71
59	002152	广电运通	173,400	1,723,596.00	0.70
60	000883	湖北能源	405,700	1,703,940.00	0.69
61	600871	石化油服	854,500	1,691,910.00	0.69
62	600398	海澜之家	306,700	1,625,510.00	0.66
63	600392	盛和资源	115,800	1,621,200.00	0.66
64	002081	金螳螂	333,200	1,616,020.00	0.66
65	000156	华数传媒	214,500	1,606,605.00	0.65
66	000988	华工科技	97,100	1,593,411.00	0.65
67	600718	东软集团	154,604	1,538,309.80	0.62
68	600064	南京高科	231,900	1,532,859.00	0.62
69	600201	生物股份	165,300	1,489,353.00	0.60
70	000060	中金岭南	356,000	1,459,600.00	0.59
71	600673	东阳光	160,200	1,392,138.00	0.56
72	002250	联化科技	87,100	1,350,050.00	0.55
73	002273	水晶光电	107,991	1,273,213.89	0.52
74	600482	中国动力	82,900	1,267,541.00	0.51
75	601118	海南橡胶	288,500	1,263,630.00	0.51
76	601928	凤凰传媒	155,400	1,230,768.00	0.50
77	600998	九州通	92,400	1,204,896.00	0.49
78	300144	宋城演艺	82,400	1,203,040.00	0.49
79	601233	桐昆股份	81,400	1,176,230.00	0.48
80	688390	固德威	3,600	1,163,124.00	0.47
81	601162	天风证券	378,200	1,085,434.00	0.44
82	000402	金融街	206,300	1,083,075.00	0.44
83	002048	宁波华翔	77,000	1,070,300.00	0.43
84	002138	顺络电子	40,100	1,049,818.00	0.43
85	600879	航天电子	149,900	1,019,320.00	0.41
86	002434	万里扬	126,000	1,014,300.00	0.41
87	000998	隆平高科	56,600	909,562.00	0.37
88	600399	抚顺特钢	61,800	884,358.00	0.36
89	605358	立昂微	20,000	852,000.00	0.35

90	300832	新产业	16,400	822,296.00	0.33
91	000401	冀东水泥	98,600	811,478.00	0.33
92	002373	千方科技	88,000	784,960.00	0.32
93	600008	首创环保	272,400	770,892.00	0.31
94	600985	淮北矿业	56,000	716,800.00	0.29
95	002511	中顺洁柔	47,880	657,871.20	0.27
96	000009	中国宝安	49,600	599,664.00	0.24
97	600348	华阳股份	41,200	587,100.00	0.24
98	000785	居然之家	141,200	577,508.00	0.23
99	002110	三钢闽光	119,800	563,060.00	0.23
100	002266	浙富控股	135,200	528,632.00	0.21
101	603866	桃李面包	31,600	486,640.00	0.20
102	300257	开山股份	30,284	454,260.00	0.18
103	603077	和邦生物	144,800	440,192.00	0.18
104	600489	中金黄金	52,200	427,518.00	0.17
105	002673	西部证券	68,900	419,601.00	0.17
106	000975	银泰黄金	35,300	389,712.00	0.16
107	002078	太阳纸业	32,400	373,248.00	0.15
108	300146	汤臣倍健	16,300	371,966.00	0.15
109	600329	达仁堂	12,700	369,570.00	0.15
110	000400	许继电气	16,700	333,499.00	0.14
111	000563	陕国投 A	106,700	323,301.00	0.13
112	002065	东华软件	55,800	315,828.00	0.13
113	600377	宁沪高速	38,300	314,826.00	0.13
114	603568	伟明环保	14,900	276,097.00	0.11
115	600497	驰宏锌锗	50,200	254,012.00	0.10
116	000970	中科三环	18,300	249,612.00	0.10
117	600827	百联股份	20,200	244,824.00	0.10
118	601187	厦门银行	42,600	244,098.00	0.10
119	600704	物产中大	49,000	235,690.00	0.10
120	603156	养元饮品	9,400	209,338.00	0.08
121	600563	法拉电子	1,300	207,844.00	0.08
122	002408	齐翔腾达	26,400	185,856.00	0.08
123	601869	长飞光纤	5,200	169,676.00	0.07
124	600928	西安银行	48,000	168,960.00	0.07
125	688208	道通科技	5,300	167,215.00	0.07
126	000878	云南铜业	13,800	162,150.00	0.07
127	601198	东兴证券	19,900	153,628.00	0.06
128	300724	捷佳伟创	1,200	136,824.00	0.06
129	600765	中航重机	4,300	133,687.00	0.05
130	000630	铜陵有色	40,600	126,672.00	0.05
131	603737	三棵树	1,100	125,213.00	0.05
132	002507	涪陵榨菜	4,800	123,696.00	0.05

133	000959	首钢股份	32,800	123,656.00	0.05
134	600820	隧道股份	21,300	112,251.00	0.05
135	002508	老板电器	4,000	111,040.00	0.05
136	601016	节能风电	28,870	109,994.70	0.04
137	600118	中国卫星	5,100	109,905.00	0.04
138	300676	华大基因	2,100	108,549.00	0.04
139	600177	雅戈尔	17,100	108,243.00	0.04
140	000825	太钢不锈	24,700	106,704.00	0.04
141	000830	鲁西化工	8,600	106,554.00	0.04
142	600535	天士力	9,900	106,524.00	0.04
143	000656	金科股份	55,000	105,050.00	0.04
144	002281	光迅科技	6,400	100,608.00	0.04
145	600259	广晟有色	2,500	100,500.00	0.04
146	603605	珀莱雅	600	100,488.00	0.04
147	300888	稳健医疗	1,400	100,100.00	0.04
148	002738	中矿资源	1,500	99,990.00	0.04
149	688819	天能股份	2,700	99,198.00	0.04
150	603228	景旺电子	4,900	99,176.00	0.04
151	603893	瑞芯微	1,400	96,334.00	0.04
152	688289	圣湘生物	4,300	94,385.00	0.04
153	002146	荣盛发展	41,800	90,706.00	0.04
154	600927	永安期货	5,600	90,272.00	0.04
155	600707	彩虹股份	21,400	88,596.00	0.04
156	688185	康希诺	600	87,612.00	0.04
157	603868	飞科电器	1,300	87,529.00	0.04
158	603233	大参林	2,200	87,120.00	0.04
159	600373	中文传媒	8,800	84,216.00	0.03
160	300383	光环新网	10,000	81,600.00	0.03
161	002505	鹏都农牧	29,800	76,884.00	0.03
162	603056	德邦股份	3,600	74,988.00	0.03
163	002025	航天电器	1,100	72,875.00	0.03
164	603225	新凤鸣	6,600	71,808.00	0.03
165	300741	华宝股份	3,000	70,590.00	0.03
166	600409	三友化工	10,400	68,744.00	0.03
167	688063	派能科技	200	63,130.00	0.03
168	603444	吉比特	200	62,568.00	0.03
169	300308	中际旭创	2,300	62,169.00	0.03
170	300474	景嘉微	1,100	60,027.00	0.02
171	600598	北大荒	4,300	59,168.00	0.02
172	300182	捷成股份	12,800	57,216.00	0.02
173	600959	江苏有线	17,600	52,272.00	0.02
174	300682	朗新科技	2,300	50,554.00	0.02
175	601997	贵阳银行	9,000	49,410.00	0.02

176	603712	七一二	1,300	45,396.00	0.02
177	603939	益丰药房	700	44,688.00	0.02
178	688385	复旦微电	600	41,886.00	0.02
179	600968	海油发展	14,400	41,472.00	0.02
180	600352	浙江龙盛	4,000	39,600.00	0.02
181	002867	周大生	2,800	39,284.00	0.02
182	002080	中材科技	1,800	38,574.00	0.02
183	002925	盈趣科技	2,200	36,344.00	0.01
184	000623	吉林敖东	2,300	34,477.00	0.01
185	601156	东航物流	2,200	33,572.00	0.01
186	600546	山煤国际	2,300	33,327.00	0.01
187	002939	长城证券	4,000	33,120.00	0.01
188	002010	传化智联	6,100	32,574.00	0.01
189	600258	首旅酒店	1,200	29,760.00	0.01
190	600623	华谊集团	4,400	27,808.00	0.01
191	003035	南网能源	4,900	27,783.00	0.01
192	601077	渝农商行	7,700	27,181.00	0.01
193	600782	新钢股份	5,600	22,904.00	0.01
194	002056	横店东磁	1,200	22,488.00	0.01
195	002423	中粮资本	2,900	20,764.00	0.01
196	601598	中国外运	5,200	19,968.00	0.01
197	000961	中南建设	8,900	19,491.00	0.01
198	002396	星网锐捷	1,000	19,160.00	0.01
199	000937	冀中能源	3,000	19,080.00	0.01
200	600536	中国软件	300	17,499.00	0.01
201	600032	浙江新能	1,500	17,235.00	0.01
202	001203	大中矿业	1,300	16,809.00	0.01
203	300390	天华超净	300	16,764.00	0.01
204	002429	兆驰股份	4,500	15,705.00	0.01
205	300136	信维通信	900	14,859.00	0.01
206	600642	申能股份	2,600	14,274.00	0.01
207	603638	艾迪精密	900	13,428.00	0.01
208	002191	劲嘉股份	1,700	12,291.00	0.00
209	000728	国元证券	1,600	10,128.00	0.00
210	600096	云天化	400	8,416.00	0.00
211	000990	诚志股份	900	7,920.00	0.00
212	688772	珠海冠宇	400	7,456.00	0.00
213	600208	新湖中宝	2,800	7,112.00	0.00
214	300072	海新能科	1,600	6,976.00	0.00
215	002936	郑州银行	2,600	6,110.00	0.00
216	688777	中控技术	67	6,085.61	0.00
217	601577	长沙银行	800	5,408.00	0.00
218	000012	南玻 A	800	5,368.00	0.00

219	300558	贝达药业	100	4,927.00	0.00
220	688099	晶晨股份	68	4,794.68	0.00
221	600917	重庆燃气	400	3,184.00	0.00
222	600487	亨通光电	200	3,012.00	0.00
223	002368	太极股份	100	2,813.00	0.00
224	603355	莱克电气	100	2,804.00	0.00
225	600970	中材国际	300	2,556.00	0.00
226	600862	中航高科	100	2,229.00	0.00
227	300058	蓝色光标	400	2,020.00	0.00
228	601872	招商轮船	300	1,677.00	0.00
229	600170	上海建工	600	1,560.00	0.00
230	600066	宇通客车	200	1,502.00	0.00
231	600131	国网信通	100	1,496.00	0.00
232	300115	长盈精密	100	1,033.00	0.00
233	000598	兴蓉环境	200	978.00	0.00
234	002385	大北农	100	890.00	0.00
235	002465	海格通信	100	812.00	0.00
236	600808	马钢股份	200	562.00	0.00
237	600839	四川长虹	200	528.00	0.00
238	688002	睿创微纳	14	520.66	0.00
239	600157	永泰能源	100	153.00	0.00
240	601880	辽港股份	3	4.86	0.00

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	002180	纳思达	39,000	2,023,710.00	0.82
2	605086	龙高股份	103,400	1,987,348.00	0.81
3	603790	雅运股份	197,300	1,974,973.00	0.80
4	603326	我乐家居	242,100	1,931,958.00	0.78
5	600250	南纺股份	241,400	1,407,362.00	0.57
6	600522	中天科技	77,100	1,245,165.00	0.50
7	300979	华利集团	20,000	1,142,200.00	0.46
8	688070	纵横股份	18,600	786,222.00	0.32
9	601138	工业富联	77,500	711,450.00	0.29
10	600422	昆药集团	46,500	656,580.00	0.27
11	300769	德方纳米	2,300	528,057.00	0.21
12	600572	康恩贝	106,200	502,326.00	0.20
13	600028	中国石化	110,200	480,472.00	0.19
14	605218	伟时电子	30,200	416,760.00	0.17
15	603950	长源东谷	25,700	408,630.00	0.17
16	600188	兖矿能源	12,000	402,960.00	0.16
17	300880	迦南智能	27,800	402,266.00	0.16
18	688616	西力科技	38,400	401,664.00	0.16

19	603703	盛洋科技	28,100	400,144.00	0.16
20	600337	美克家居	138,800	391,416.00	0.16
21	000922	佳电股份	43,100	386,607.00	0.16
22	601616	广电电气	113,400	384,426.00	0.16
23	600547	山东黄金	20,000	383,200.00	0.16
24	688428	诺诚健华	29,694	380,974.02	0.15
25	600562	国睿科技	21,700	367,815.00	0.15
26	002952	亚世光电	23,700	355,026.00	0.14
27	002967	广电计量	19,700	330,566.00	0.13
28	688335	复洁环保	15,100	314,231.00	0.13
29	688139	海尔生物	4,900	310,170.00	0.13
30	688028	沃尔德	9,600	300,192.00	0.12
31	300407	凯发电气	41,800	300,124.00	0.12
32	688183	生益电子	29,600	275,576.00	0.11
33	300930	屹通新材	10,100	243,612.00	0.10
34	601899	紫金矿业	24,300	243,000.00	0.10
35	600768	宁波富邦	24,500	225,155.00	0.09
36	603188	亚邦股份	56,200	207,378.00	0.08
37	688520	神州细胞	3,400	206,040.00	0.08
38	603697	有友食品	16,300	202,772.00	0.08
39	603006	黎明股份	22,300	196,240.00	0.08
40	002887	绿茵生态	22,200	188,256.00	0.08
41	600285	羚锐制药	14,100	183,864.00	0.07
42	601163	三角轮胎	14,500	177,045.00	0.07
43	600519	贵州茅台	100	172,700.00	0.07
44	605158	华达新材	25,300	161,920.00	0.07
45	601319	中国人保	30,500	159,210.00	0.06
46	002955	鸿合科技	6,700	157,785.00	0.06
47	600426	华鲁恒升	4,700	155,805.00	0.06
48	603221	爱丽家居	18,600	149,916.00	0.06
49	601288	农业银行	50,200	146,082.00	0.06
50	600538	国发股份	30,200	136,504.00	0.06
51	688293	奥浦迈	1,367	135,497.04	0.05
52	601857	中国石油	27,100	134,687.00	0.05
53	000048	京基智农	6,600	117,810.00	0.05
54	300430	诚益通	9,900	114,444.00	0.05
55	300896	爱美客	200	113,270.00	0.05
56	688098	申联生物	13,000	103,220.00	0.04
57	688432	有研硅	9,100	102,284.00	0.04
58	300760	迈瑞医疗	300	94,791.00	0.04
59	601318	中国平安	2,000	94,000.00	0.04
60	601939	建设银行	16,400	92,332.00	0.04
61	002049	紫光国微	700	92,274.00	0.04

62	688362	甬矽电子	4,785	91,776.30	0.04
63	603260	合盛硅业	1,100	91,234.00	0.04
64	688536	思瑞浦	328	90,334.48	0.04
65	002475	立讯精密	2,800	88,900.00	0.04
66	688489	三未信安	945	85,635.90	0.03
67	000735	罗牛山	11,900	84,133.00	0.03
68	603377	东方时尚	12,500	80,375.00	0.03
69	600830	香溢融通	12,700	80,010.00	0.03
70	300628	亿联网络	1,300	78,767.00	0.03
71	300750	宁德时代	200	78,684.00	0.03
72	688177	百奥泰	3,600	78,408.00	0.03
73	603861	白云电器	10,400	77,688.00	0.03
74	600900	长江电力	3,500	73,500.00	0.03
75	600054	黄山旅游	5,500	70,070.00	0.03
76	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
77	600309	万华化学	700	64,855.00	0.03
78	688585	上纬新材	8,000	64,080.00	0.03
79	688459	哈铁科技	7,705	63,720.35	0.03
80	600690	海尔智家	2,500	61,150.00	0.02
81	300033	同花顺	600	59,166.00	0.02
82	688370	从麟科技	1,667	58,128.29	0.02
83	600036	招商银行	1,300	48,438.00	0.02
84	300575	中旗股份	2,200	48,114.00	0.02
85	600893	航发动力	1,100	46,508.00	0.02
86	600887	伊利股份	1,500	46,500.00	0.02
87	603920	世运电路	3,200	46,016.00	0.02
88	301302	华如科技	700	44,821.00	0.02
89	688096	京源环保	3,400	41,038.00	0.02
90	688600	皖仪科技	1,600	39,968.00	0.02
91	601100	恒立液压	600	37,890.00	0.02
92	601668	中国建筑	6,500	35,295.00	0.01
93	601328	交通银行	7,100	33,654.00	0.01
94	300445	康斯特	2,700	32,940.00	0.01
95	000063	中兴通讯	1,200	31,032.00	0.01
96	601658	邮储银行	6,600	30,492.00	0.01
97	600999	招商证券	2,200	29,260.00	0.01
98	002946	新乳业	2,100	27,783.00	0.01
99	301239	普瑞眼科	384	26,757.12	0.01
100	600548	深高速	2,800	25,144.00	0.01
101	600643	爱建集团	4,500	24,840.00	0.01
102	603316	诚邦股份	4,200	23,940.00	0.01
103	301269	华大九天	268	23,567.92	0.01
104	301175	中科环保	3,525	21,185.25	0.01

105	301095	广立微	244	21,103.56	0.01
106	300810	中科海讯	1,200	20,784.00	0.01
107	301327	华宝新能	109	19,289.73	0.01
108	002240	盛新锂能	500	18,745.00	0.01
109	603353	和顺石油	1,000	18,580.00	0.01
110	000858	五粮液	100	18,069.00	0.01
111	600626	申达股份	4,900	17,640.00	0.01
112	300122	智飞生物	200	17,566.00	0.01
113	300779	惠城环保	500	17,050.00	0.01
114	600025	华能水电	2,500	16,500.00	0.01
115	603259	药明康德	200	16,200.00	0.01
116	301308	江波龙	277	15,711.44	0.01
117	300015	爱尔眼科	500	15,535.00	0.01
118	601728	中国电信	3,700	15,503.00	0.01
119	301367	怡和嘉业	85	14,941.30	0.01
120	301301	川宁生物	1,984	14,939.52	0.01
121	603739	蔚蓝生物	1,100	14,762.00	0.01
122	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.01
123	301195	北路智控	180	13,147.20	0.01
124	688388	嘉元科技	290	13,006.50	0.01
125	605333	沪光股份	600	12,792.00	0.01
126	002027	分众传媒	1,900	12,692.00	0.01
127	301267	华夏眼科	186	12,313.20	0.00
128	301311	昆船智能	707	11,213.02	0.00
129	301363	美好医疗	292	11,052.20	0.00
130	603010	万盛股份	900	10,647.00	0.00
131	301273	瑞晨环保	272	10,278.88	0.00
132	688012	中微公司	100	9,801.00	0.00
133	301330	熵基科技	309	9,674.79	0.00
134	301391	卡莱特	119	9,635.43	0.00
135	301356	天振股份	221	9,575.93	0.00
136	301165	锐捷网络	298	9,419.78	0.00
137	301121	紫建电子	189	9,406.53	0.00
138	301306	西测测试	222	9,388.38	0.00
139	301377	鼎泰高科	520	9,167.60	0.00
140	301132	满坤科技	374	9,155.52	0.00
141	301296	新巨丰	608	9,059.20	0.00
142	301283	聚胶股份	175	8,996.75	0.00
143	301335	天元宠物	258	8,725.56	0.00
144	301339	通行宝	553	8,621.27	0.00
145	301328	维峰电子	112	8,619.52	0.00
146	301389	隆扬电子	497	8,528.52	0.00
147	301290	东星医疗	242	8,501.46	0.00

148	301326	捷邦科技	222	8,129.64	0.00
149	301223	中荣股份	443	8,031.59	0.00
150	603536	惠发食品	1,000	7,980.00	0.00
151	301171	易点天下	443	7,849.96	0.00
152	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
153	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
154	301115	建科股份	305	7,332.20	0.00
155	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
156	300919	中伟股份	100	6,561.00	0.00
157	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
158	301349	信德新材	63	6,521.76	0.00
159	301282	金禄电子	257	6,489.25	0.00
160	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
161	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
162	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
163	301265	华新环保	524	5,973.60	0.00
164	002352	顺丰控股	100	5,776.00	0.00
165	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
166	002963	豪尔赛	400	5,500.00	0.00
167	301276	嘉曼服饰	242	5,471.62	0.00
168	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
169	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
170	301318	维海德	123	5,134.02	0.00
171	301309	万得凯	159	3,889.14	0.00
172	301078	孩子王	100	1,295.00	0.00
173	603081	大丰实业	100	1,246.00	0.00
174	601218	吉鑫科技	100	397.00	0.00
175	000717	中南股份	100	285.00	0.00
176	600881	亚泰集团	100	240.00	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	600673	东阳光	18,201,267.00	5.16
2	000887	中鼎股份	16,225,520.39	4.60
3	600348	华阳股份	13,852,410.00	3.93
4	688390	固德威	12,503,175.46	3.55
5	002409	雅克科技	12,490,793.16	3.54
6	300724	捷佳伟创	12,132,326.00	3.44
7	600549	厦门钨业	12,017,027.56	3.41
8	600522	中天科技	11,984,809.00	3.40
9	688208	道通科技	10,641,408.55	3.02

10	600201	生物股份	10,556,143.40	2.99
11	600256	广汇能源	10,335,421.75	2.93
12	300073	当升科技	10,233,832.00	2.90
13	603456	九洲药业	10,225,002.78	2.90
14	601699	潞安环能	10,007,571.03	2.84
15	000975	银泰黄金	9,999,472.08	2.84
16	300699	光威复材	9,685,580.00	2.75
17	000553	安道麦 A	9,649,865.98	2.74
18	300418	昆仑万维	9,638,198.15	2.73
19	002203	海亮股份	9,603,917.00	2.72
20	002416	爱施德	9,418,663.80	2.67
21	600699	均胜电子	9,162,726.00	2.60
22	688188	柏楚电子	9,151,264.33	2.60
23	600970	中材国际	9,123,328.39	2.59
24	600141	兴发集团	9,052,778.00	2.57
25	601615	明阳智能	8,910,801.12	2.53
26	002294	信立泰	8,840,856.00	2.51
27	601880	辽港股份	8,658,341.13	2.46
28	601992	金隅集团	8,591,649.00	2.44
29	002273	水晶光电	8,582,430.37	2.43
30	002407	多氟多	8,469,192.00	2.40
31	600282	南钢股份	8,437,781.00	2.39
32	002653	海思科	8,437,473.82	2.39
33	600967	内蒙一机	8,324,665.00	2.36
34	601928	凤凰传媒	8,269,790.87	2.35
35	600867	通化东宝	8,129,908.00	2.31
36	600765	中航重机	8,115,935.00	2.30
37	000519	中兵红箭	8,105,259.00	2.30
38	603613	国联股份	8,062,160.10	2.29
39	002191	劲嘉股份	8,037,830.16	2.28
40	300390	天华超净	7,978,066.00	2.26
41	600298	安琪酵母	7,924,281.27	2.25
42	601098	中南传媒	7,913,899.00	2.24
43	603568	伟明环保	7,895,541.27	2.24
44	600519	贵州茅台	7,774,270.00	2.20
45	688002	睿创微纳	7,705,550.42	2.19
46	600008	首创环保	7,671,372.00	2.18
47	002594	比亚迪	7,560,076.00	2.14
48	002250	联化科技	7,461,411.00	2.12
49	600566	济川药业	7,404,132.76	2.10
50	601717	郑煤机	7,382,381.70	2.09
51	300750	宁德时代	7,364,830.78	2.09
52	300144	宋城演艺	7,315,207.00	2.07

53	300251	光线传媒	7,312,406.00	2.07
54	688029	南微医学	7,308,954.23	2.07
55	000960	锡业股份	7,266,680.36	2.06
56	688005	容百科技	7,242,037.92	2.05
57	600160	巨化股份	7,232,333.70	2.05
58	601298	青岛港	7,144,966.00	2.03
59	601128	常熟银行	7,098,248.00	2.01
60	600236	桂冠电力	7,075,517.69	2.01
61	688521	芯原股份	7,069,056.91	2.00
62	601872	招商轮船	7,062,282.60	2.00
63	600863	内蒙华电	7,058,426.00	2.00

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	600673	东阳光	19,382,142.98	5.50
2	000887	中鼎股份	17,689,269.00	5.02
3	300724	捷佳伟创	14,617,625.00	4.15
4	600348	华阳股份	14,178,638.00	4.02
5	600256	广汇能源	13,537,629.67	3.84
6	688390	固德威	12,213,600.46	3.46
7	600522	中天科技	11,510,960.00	3.26
8	601615	明阳智能	11,138,370.89	3.16
9	688208	道通科技	10,761,609.10	3.05
10	300418	昆仑万维	10,542,141.00	2.99
11	688005	容百科技	10,468,788.65	2.97
12	000975	银泰黄金	10,265,002.40	2.91
13	300037	新宙邦	9,995,109.17	2.83
14	600141	兴发集团	9,842,587.00	2.79
15	603456	九洲药业	9,649,379.05	2.74
16	600970	中材国际	9,644,418.00	2.74
17	600549	厦门钨业	9,397,032.85	2.66
18	601699	潞安环能	9,384,626.00	2.66
19	300251	光线传媒	9,337,632.00	2.65
20	603568	伟明环保	9,290,280.59	2.63
21	600157	永泰能源	9,201,454.00	2.61
22	600862	中航高科	9,156,822.00	2.60
23	002244	滨江集团	9,129,352.69	2.59
24	601958	金钼股份	9,074,776.99	2.57
25	002409	雅克科技	9,064,750.00	2.57

26	300751	迈为股份	8,994,570.60	2.55
27	002416	爱施德	8,931,578.55	2.53
28	600699	均胜电子	8,881,804.98	2.52
29	300750	宁德时代	8,793,764.00	2.49
30	000733	振华科技	8,785,342.00	2.49
31	002203	海亮股份	8,538,300.40	2.42
32	603613	国联股份	8,494,735.60	2.41
33	601880	辽港股份	8,466,289.00	2.40
34	002407	多氟多	8,450,278.12	2.40
35	688188	柏楚电子	8,419,527.85	2.39
36	300073	当升科技	8,351,388.00	2.37
37	600201	生物股份	8,319,639.40	2.36
38	002430	杭氧股份	8,228,238.00	2.33
39	000960	锡业股份	8,187,849.00	2.32
40	600765	中航重机	8,163,074.80	2.31
41	002653	海思科	8,151,642.45	2.31
42	002180	纳思达	8,089,563.94	2.29
43	600233	圆通速递	8,050,697.42	2.28
44	002191	劲嘉股份	8,036,113.36	2.28
45	000519	中兵红箭	8,005,737.00	2.27
46	600027	华电国际	7,958,061.00	2.26
47	002273	水晶光电	7,940,903.00	2.25
48	600959	江苏有线	7,899,039.60	2.24
49	601689	拓普集团	7,885,704.30	2.24
50	000629	钒钛股份	7,839,229.50	2.22
51	002183	怡亚通	7,832,919.00	2.22
52	300699	光威复材	7,711,069.09	2.19
53	688029	南微医学	7,652,464.05	2.17
54	300390	天华超净	7,642,132.00	2.17
55	688521	芯原股份	7,635,801.87	2.17
56	600863	内蒙华电	7,568,003.00	2.15
57	300763	锦浪科技	7,505,452.50	2.13
58	000009	中国宝安	7,496,544.09	2.13
59	002594	比亚迪	7,473,068.00	2.12
60	600008	首创环保	7,465,568.00	2.12
61	600487	亨通光电	7,415,568.00	2.10
62	002294	信立泰	7,407,279.00	2.10
63	688002	睿创微纳	7,399,209.53	2.10
64	600519	贵州茅台	7,398,490.00	2.10
65	000415	渤海租赁	7,397,340.00	2.10
66	300244	迪安诊断	7,346,962.00	2.08
67	601872	招商轮船	7,276,709.04	2.06
68	000709	河钢股份	7,260,211.00	2.06

69	600801	华新水泥	7,248,267.00	2.06
70	002465	海格通信	7,222,599.50	2.05
71	600236	桂冠电力	7,206,575.40	2.04
72	300285	国瓷材料	7,188,595.00	2.04
73	600160	巨化股份	7,118,663.00	2.02
74	000156	华数传媒	7,060,773.97	2.00

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	3,018,879,973.98
卖出股票收入（成交）总额	3,056,470,965.10

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	819.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	819.26

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
工银中证 500 六个 月持有指 数增强 A	2,694	67,919.82	10,731,116.88	5.86	172,244,891.46	94.14
工银中证 500 六个 月持有指 数增强 C	2,265	44,839.79	200,088.00	0.20	101,362,029.97	99.80
合计	4,959	57,378.13	10,931,204.88	3.84	273,606,921.43	96.16

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理 人所有从 业人员持 有本基金	工银中证 500 六个月持有指数增 强 A	3,066.16	0.00
	工银中证 500 六个月持有指数增 强 C	85,019.50	0.08
	合计	88,085.66	0.03

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
基金合同生效日 (2021 年 12 月 14 日) 基金份额总额	222,136,943.55	127,947,826.06
本报告期期初基金份 额总额	222,151,830.80	127,955,111.16

本报告期基金总申购份额	6,800,817.50	7,890,433.21
减：本报告期基金总赎回份额	45,976,639.96	34,283,426.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	182,976,008.34	101,562,117.97

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

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

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 (%)	
西南证券	2	6,055,260,692.07	100.00	5,279,276.20	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(%)
西南证券	2,086,472.45	100.00	-	-	-	-

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终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 4 月 28 日
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
5	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统继续开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 12 月 30 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 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金募集申请的注册

文件：

- 2、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

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