

工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	工银灵活配置混合	
基金主代码	487016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 9 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	161,297,638.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银灵活配置混合 A	工银灵活配置混合 B
下属分级基金的交易代码	487016	001428
报告期末下属分级基金的份额总额	161,297,638.05 份	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险并保持良好流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，获得超过业绩比较基准的长期投资收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在基于充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，对基金资产进行灵活资产配置，在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，降低权益类资产配置比例，力求实现基金资产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×55%+中债信用债总财富指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	石立平
	联系电话	400-811-9999	010-63639180
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-811-9999	95595
传真		010-66583158	010-63639132

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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100033	100033
法定代表人	赵桂才	王江

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	工银灵活配置混合 A	工银灵活配置混合 B
本期已实现收益	-1,096,592.16	-
本期利润	11,889,715.64	-
加权平均基金份额本期利润	0.0926	-
本期加权平均净值利润率	3.58%	-
本期基金份额净值增长率	4.38%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	278,504,107.48	-
期末可供分配基金份额利润	1.7266	-
期末基金资产净值	416,019,160.90	-

期末基金份额净值	2.5792	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	126.44%	-

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。

5、所列报告期间或期末无数据则为该报告期间或期末无该类份额。

3.2 基金净值表现

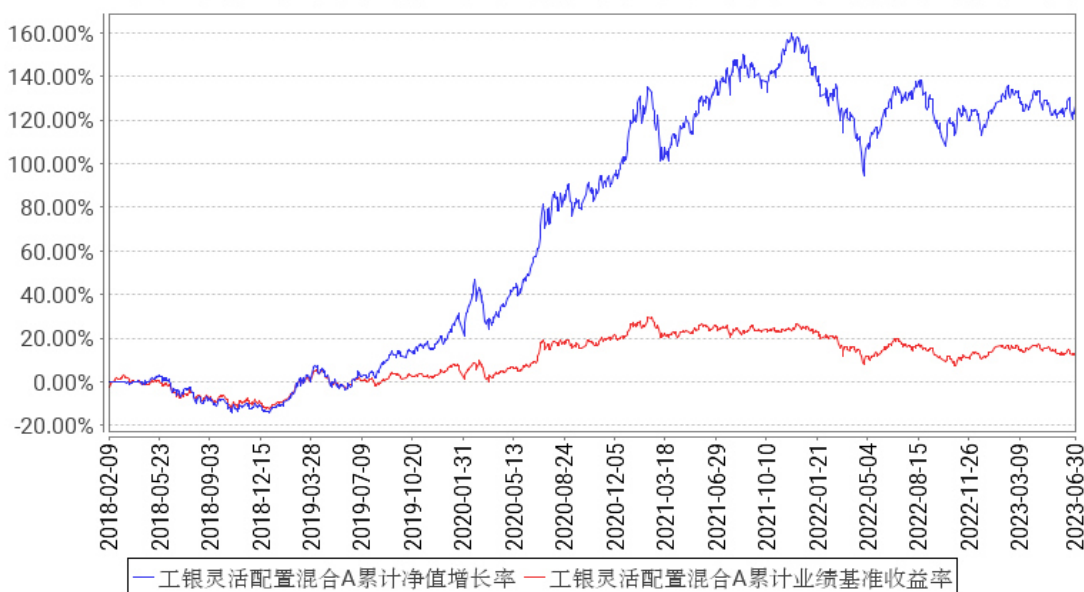
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.29%	0.91%	0.49%	0.47%	0.80%	0.44%
过去三个月	-0.37%	0.76%	-2.31%	0.44%	1.94%	0.32%
过去六个月	4.38%	0.71%	1.33%	0.44%	3.05%	0.27%
过去一年	-3.02%	0.81%	-5.47%	0.52%	2.45%	0.29%
过去三年	40.33%	1.12%	2.93%	0.64%	37.40%	0.48%
自基金合同生效起至今	126.44%	1.10%	12.94%	0.69%	113.50%	0.41%

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

工银灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2018 年 2 月 9 日转型为工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金。

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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是由中国工商银行绝对控股、独立运营的基金公司，工商银行拥有 80% 股权，瑞士信贷拥有 20% 股权。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 2005 年 6 月成立以来，公司坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足专业化、综合化、国际化、数字化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资、绿色投资、责任投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、

私募资产管理计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII、公募基金投顾等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

工银瑞信(含子公司)以持续优秀的投资业绩、完善周到的服务，为逾 8500 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 2023 年 6 月 30 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 238 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模超过 1.7 万亿元，养老金管理规模居行业领先。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李昱	固定收益部投资副总监、本基金的基金经理	2018 年 3 月 6 日	-	16 年	硕士研究生。曾任中投证券研究员，华安基金高级研究员、小组负责人，中信产业基金从事二级市场投研；2017 年加入工银瑞信，现任固定收益部投资副总监、基金经理。2018 年 1 月 23 日至 2020 年 7 月 3 日，担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理；2018 年 1 月 23 日至 2021 年 7 月 2 日，担任工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 1 月 23 日至 2023 年 8 月 11 日，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 23 日至 2019 年 1 月 15 日，担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 23 日至 2019 年 8 月 14 日，担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 23 日至 2021 年 1 月 18 日，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(LOF)基金经理；2018 年 2 月 23 日至今，担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 6 日至今，担任工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 1 月 24 日至 2019 年 10 月 31 日，担任工银瑞信聚盈混合型证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 17 日至 2021 年 3 月 2 日，担任工银瑞信瑞盈 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 17

					日至今，担任工银瑞信聚福混合型证券投资基金基金经理；2020 年 12 月 21 日至今，担任工银瑞信高质量成长混合型证券投资基金基金经理；2022 年 8 月 1 日至今，担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信双利债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合未发生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。

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

2023 年上半年宏观经济在疫情防控、地产调控等外生因素的冲击消退后，进入平稳复苏阶段，

但整体运行强度弱于之前预期。在外需表现好于预期的背景下，各项内需相关指标增长斜率放缓，居民消费和企业投资还需修复。经济目前的核心矛盾在于需求不足，一方面地产销售大幅下滑，另一方面消费需求也出现下行压力。现阶段政策坚持偏重高质量发展及产业结构调整等长期方向，逆周期调节工具运用较为审慎。

而美联储上半年仍处在加息周期内，这一阶段新兴市场货币大多数承受了贬值压力，也影响了资本端的流动。

AI 技术的发展是 2023 年最引人关注的产业变化，也有可能是未来 3 至 5 年最重要的产业趋势。美国的 AI 基础能力领先，软件基础更加成熟、付费意愿更强，因此持续出现落地应用；国内公司也在加大 AI 的研究投入，迅速的进行模型层和应用层的开发以及算力的部署，目前处于追赶的状态。

上半年沪深 300 下跌 0.75%，结构分化明显，在经济总量平稳的情况下，与 AI 产业链相关的 TMT 板块涨幅居前。

本基金的投资策略是自下而上选股均衡配置。报告期内维持行业和个股的均衡配置，仍以各行业成长性较强的个股为持仓主体，小幅增加了高股息个股的比例以平衡组合。我们在选择个股的过程中，坚持价值投资的原则，除了传统的投资价值之外，也会考虑企业的社会价值与产业价值。同时，我们增加了赔率因素在选股中的占比。

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 4.38%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 1.33%，B 份额为 0。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济从高速增长进入高质量增长的时代。需求的放缓和过剩供给的消化需要时间，政策的着眼点更加长远，对短期经济刺激的预期不宜过于乐观，未来中国经济可能在一个新的增长速度上实现均衡。但从资产价格来看，已经隐含了较为悲观的经济增长预期，权益资产和债券相比估值水平处于历史较低位置，如果未来上市公司的 ROE 水平不出现显著的下行，那么中长期看权益资产的回报率将优于债券。

我们认为多数行业可能都有机会，表现会相对均衡：经营稳定的高股息资产优于债券；消费和内需为主的周期品估值水平已经较低，具备较好赔率；中长期看仍要关注产业发展趋势带来的机会，AI 是变化最大的产业，知识密集型行业未来可能全面 AI 化，生产效率提升明显，从而有望带来全社会生产率的提高，但 AI 产业仍处于早期发展阶段，格局也有许多尚未明确的方面，比如开源与闭源、综合性大模型与垂直领域模型、2B 与 2C 等，同时新技术也会带来安全与社会问

题，AI 的产业化进度尚处于早期，相关公司可能会有较大的波动，我们未来研究的重点会放在 AI 应用的落地上。除此之外，高端制造业的安全自主可控、汽车智能化、能源结构调整也是我们持续关注的产业方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，原则上为运作部、投研部门（研究部或固定收益部）、风险管理部、法律合规部的部门负责人构成，组长由运作部负责人担任。

如遇相关部门负责人无法参与小组会议的情况，由其指定相关人员代为履行职责。

（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

投资经理可发起并参与所管理组合持仓证券的风险事件的估值讨论，但不得参与决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托

管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,996,064.75	17,221,982.22
结算备付金		1,519,541.92	1,681,768.34
存出保证金		48,353.34	54,632.38
交易性金融资产	6.4.7.2	387,093,717.77	250,623,171.47
其中：股票投资		307,987,718.31	188,206,227.40
基金投资		-	-
债券投资		79,105,999.46	62,416,944.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,995,615.61	14,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,392,663.94	1,427,208.28
应收股利		-	-
应收申购款		21,307,328.40	47,160.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		422,353,285.73	285,055,922.94
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,128,400.87	14,387,806.29
应付赎回款		448,550.39	2,142,352.80
应付管理人报酬		479,765.17	345,613.40
应付托管费		79,960.89	57,602.22
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		392.14	211.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,197,055.37	3,151,627.86
负债合计		6,334,124.83	20,085,214.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	133,647,914.67	88,852,681.74
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	282,371,246.23	176,118,027.18
净资产合计		416,019,160.90	264,970,708.92
负债和净资产总计		422,353,285.73	285,055,922.94

注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 2 月 9 日。

2、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额为 161,297,638.05 份。其中工银灵活配置混合 A 基金份额总额为 161,297,638.05 份，基金份额净值为人民币 2.5792 元，无 B 类基金份额。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,866,676.93	-29,324,524.31
1. 利息收入		162,215.52	161,206.57
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,950.24	50,968.14
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		115,265.28	110,238.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,366,400.43	14,080,917.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,635,122.86	10,943,217.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	944,701.67	1,406,549.14
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,056,821.62	1,731,151.02
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	12,986,307.80	-43,631,730.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	351,753.18	65,081.70
减：二、营业总支出		2,976,961.29	2,354,908.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,463,330.88	1,930,215.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	410,555.11	321,702.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		172. 74	88. 14
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	102, 902. 56	102, 902. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11, 889, 715. 64	-31, 679, 432. 60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11, 889, 715. 64	-31, 679, 432. 60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11, 889, 715. 64	-31, 679, 432. 60

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	88, 852, 681. 74	-	176, 118, 027. 18	264, 970, 708. 92
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）	88, 852, 681. 74	-	176, 118, 027. 18	264, 970, 708. 92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	44, 795, 232. 93	-	106, 253, 219. 05	151, 048, 451. 98
（一）、综合收益总额	-	-	11, 889, 715. 64	11, 889, 715. 64
（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）	44, 795, 232. 93	-	94, 363, 503. 41	139, 158, 736. 34
其中：1. 基金申购款	68, 533, 578. 33	-	145, 020, 160. 97	213, 553, 739. 30
2. 基金赎回	-23, 738, 345. 40	-	-50, 656, 657. 56	-74, 395, 002. 96

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)	133,647,914.67	-	282,371,246.23	416,019,160.90
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	112,584,632.17	-	280,809,822.51	393,394,454.68
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)	112,584,632.17	-	280,809,822.51	393,394,454.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-37,172,900.48	-	-114,183,055.29	-151,355,955.77
(一)、综合收益总额	-	-	-31,679,432.60	-31,679,432.60
(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)	-37,172,900.48	-	-82,503,622.69	-119,676,523.17
其中: 1. 基金申购款	11,885,231.39	-	25,044,281.65	36,929,513.04
2. 基金赎回款	-49,058,131.87	-	-107,547,904.34	-156,606,036.21
(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)	75,411,731.69	-	166,626,767.22	242,038,498.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由工银瑞信保本混合型证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而成，原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[2011]1831 号《关于核准工银瑞信保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2011 年 12 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 3,429,896,705.59 份基金份额。原基金保本周期到期时，未符合保本基金存续条件，因此于 2018 年 2 月 9 日（本基金基金合同生效日）按照基金合同的约定转型为本基金。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“487016”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关约定进行运作。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金按照投资者的申购金额限制和销售渠道的不同将本基金的基金份额分为 A 类、B 类两类份额。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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关

规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

(2) 增值税

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

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

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

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,996,064.75
等于：本金	3,993,644.40
加：应计利息	2,420.35
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	3,996,064.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		293,394,227.29	-	307,987,718.31	14,593,491.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	47,160,548.35	1,115,713.07	48,528,419.67	252,158.25
	银行间市场	29,638,340.00	318,579.79	30,577,579.79	620,660.00
	合计	76,798,888.35	1,434,292.86	79,105,999.46	872,818.25
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		370,193,115.64	1,434,292.86	387,093,717.77	15,466,309.27

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,995,615.61	-
银行间市场	-	-
合计	5,995,615.61	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	655.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	181,887.92
其中：交易所市场	181,712.92
银行间市场	175.00
应付利息	-
预提审计费	74,795.19
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
应缴债券利息税	2,870,909.42
合计	3,197,055.37

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银灵活配置混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,235,124.04	88,852,681.74

本期申购	82,712,016.27	68,533,578.33
本期赎回（以“-”号填列）	-28,649,502.26	-23,738,345.40
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	161,297,638.05	133,647,914.67

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

工银灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	186,516,338.98	-10,398,311.80	176,118,027.18
本期利润	-1,096,592.16	12,986,307.80	11,889,715.64
本期基金份额交易产生的变动数	93,084,360.66	1,279,142.75	94,363,503.41
其中：基金申购款	142,476,179.24	2,543,981.73	145,020,160.97
基金赎回款	-49,391,818.58	-1,264,838.98	-50,656,657.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	278,504,107.48	3,867,138.75	282,371,246.23

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	36,423.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,134.24
其他	392.67
合计	46,950.24

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,635,122.86
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	-2,635,122.86

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	163,137,639.05
减：卖出股票成本总额	165,282,599.81
减：交易费用	490,162.10
买卖股票差价收入	-2,635,122.86

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	941,525.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,175.86
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	944,701.67

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,759,662.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,485,302.19
减：应计利息总额	270,698.96
减：交易费用	485.20
买卖债券差价收入	3,175.86

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,056,821.62
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	3,056,821.62

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	12,986,307.80
股票投资	12,516,326.22
债券投资	469,981.58
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	12,986,307.80

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	348,863.85
基金转换费收入	2,889.33
合计	351,753.18

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	102,902.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金管理人 2023 年 7 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，决定自 2023 年 7 月 10 日起，调低本基金的管理费率及托管费率，管理费率及托管费率分别由 1.5% 和 0.25% 调低至 1.2% 和 0.2%。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,463,330.88	1,930,215.07

其中：支付销售机构的客户维护费	1,030,278.31	773,766.45
-----------------	--------------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	410,555.11	321,702.52

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	3,996,064.75	36,423.33	3,999,172.31	40,723.74

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601669	中国电建	2023年1月17日	6个月	非公开流通受限	6.44	5.66	199,999	1,287,993.56	1,131,994.34	-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股锁定	69.72	178.59	1,200	83,664.00	214,308.00	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	2,366	136,423.56	136,423.56	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承	2023	1个月	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

	科技	年 6 月 30 日	内(含)	上市						
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定	19.86	18.06	1,864	37,019.04	33,663.84	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	1,405	15,595.50	23,941.20	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	37.88	29.49	772	29,243.36	22,766.28	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	333	7,858.80	21,535.11	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	3,926	22,338.94	21,239.66	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定	76.80	107.95	182	13,977.60	19,646.90	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定	5.00	8.96	2,118	10,590.00	18,977.28	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定	67.28	65.43	269	18,098.32	17,600.67	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.74	40.68	430	11,498.20	17,492.40	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	132	17,925.60	15,894.12	-
688562	航天软件	2023 年 5 月	6 个月	新股锁定	12.68	22.31	706	8,952.08	15,750.86	-

		15 日								
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	57.66	57.66	263	15,164.58	15,164.58	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	38.13	31.03	487	18,569.31	15,111.61	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定	43.67	53.05	280	12,227.60	14,854.00	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定	46.16	35.72	389	17,956.24	13,895.08	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定	43.99	51.57	269	11,833.31	13,872.33	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定	23.77	42.89	321	7,630.17	13,767.69	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	903	10,095.54	13,174.77	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	57.88	49.17	267	15,453.96	13,128.39	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	141	10,575.00	12,797.16	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	30.22	25.50	494	14,928.68	12,597.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301387	光大	2023	6 个月	新股锁	58.32	45.36	269	15,688.08	12,201.84	-

	同创	年 4 月 10 日		定							
301292	海科 新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
688334	西高 院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定	14.16	16.21	713	10,096.08	11,557.73		-
301315	威士 顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
688523	航天 环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁 定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
301307	美利 信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定	32.34	31.86	353	11,416.02	11,246.58		-
301360	荣旗 科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁 定	71.88	92.60	121	8,697.48	11,204.60		-
301141	中科 磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁 定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78		-
301225	恒勃 股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58		-
688552	航天 南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定	21.17	23.50	471	9,971.07	11,068.50		-
301397	溯联 股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定	53.27	40.20	275	14,649.25	11,055.00		-
688146	中船 特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定	36.15	38.13	287	10,375.05	10,943.31		-
688352	颀中 科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定	12.10	12.07	890	10,769.00	10,742.30		-
688484	南芯 科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	39.99	36.71	289	11,557.11	10,609.19		-
301303	真兰 仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股锁 定	26.80	22.32	471	12,622.80	10,512.72		-

688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	89	11,196.20	10,504.67	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	617	10,020.08	10,458.15	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	742	10,989.02	10,187.66	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	514	12,978.50	10,120.66	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	527	11,024.84	10,097.32	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	311	15,550.00	9,550.81	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	365	11,044.90	9,245.45	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	303	7,659.84	9,050.61	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	103	12,965.64	8,939.37	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	164.83	122.11	73	12,032.44	8,914.03	-
688429	时创能源	2023年6月	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

		20 日								
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	50.00	48.39	178	8,900.00	8,613.42	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	397	4,716.36	8,344.94	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	211	8,241.66	8,304.96	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定	26.66	31.50	257	6,851.62	8,095.50	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	33.73	31.85	253	8,533.69	8,058.05	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	29.99	23.79	327	9,806.73	7,779.33	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	144	8,136.00	7,621.92	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	31.56	25.10	301	9,498.70	7,555.10	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华	2023	6 个月	新股锁	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

	电子	年 5 月 16 日		定							
301428	世纪 恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301203	国泰 环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	46.13	34.40	202	9,318.26	6,948.80	-	
688479	友车 科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定	33.99	29.49	233	7,919.67	6,871.17	-	
601061	中信 金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定	6.58	7.58	879	5,783.82	6,662.82	-	
301439	泓淋 电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定	19.99	16.90	389	7,776.11	6,574.10	-	
603135	中重 科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定	17.80	17.89	314	5,589.20	5,617.46	-	
001380	华纬 科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
301345	涛涛 车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定	73.45	46.64	106	7,785.70	4,943.84	-	
601133	柏诚 股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	11.66	12.26	320	3,731.20	3,923.20	-	
601065	江盐 集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	10.36	11.84	330	3,418.80	3,907.20	-	
001282	三联 锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-	
001328	登康 口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定	20.68	25.49	127	2,626.36	3,237.23	-	
001360	南矿 集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	15.38	14.87	171	2,629.98	2,542.77	-	
603137	恒尚 节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	

001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、稽核审计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、法律合规部和各风险职能部门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，负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查，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。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	12,686,186.99	10,886,834.05
AAA 以下	5,693,353.39	4,480,872.29
未评级	-	-
合计	18,379,540.38	15,367,706.34

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,996,064.75	-	-	-	3,996,064.75
结算备付金	1,519,541.92	-	-	-	1,519,541.92
存出保证金	48,353.34	-	-	-	48,353.34
交易性金融资产	50,445,674.93	17,856,294.05	10,804,030.48	307,987,718.31	387,093,717.77
买入返售金融资产	5,995,615.61	-	-	-	5,995,615.61
应收清算款	-	-	-	2,392,663.94	2,392,663.94
应收申购款	-	-	-	21,307,328.40	21,307,328.40
资产总计	62,005,250.55	17,856,294.05	10,804,030.48	331,687,710.65	422,353,285.73
负债					
应付清算款	-	-	-	2,128,400.87	2,128,400.87
应付赎回款	-	-	-	448,550.39	448,550.39
应付管理人报酬	-	-	-	479,765.17	479,765.17
应付托管费	-	-	-	79,960.89	79,960.89
应交税费	-	-	-	392.14	392.14
其他负债	-	-	-	3,197,055.37	3,197,055.37
负债总计	-	-	-	6,334,124.83	6,334,124.83

利率敏感度缺口	62,005,250.55	17,856,294.05	10,804,030.48	325,353,585.82	416,019,160.90
上年度末 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	17,221,982.22	-	-	-	17,221,982.22
结算备付金	1,681,768.34	-	-	-	1,681,768.34
存出保证金	54,632.38	-	-	-	54,632.38
交易性金融资产	36,756,432.25	13,448,702.80	12,211,809.02	188,206,227.40	250,623,171.47
买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	14,000,000.00
应收清算款	-	-	-	1,427,208.28	1,427,208.28
应收申购款	-	-	-	47,160.25	47,160.25
资产总计	69,714,815.19	13,448,702.80	12,211,809.02	189,680,595.93	285,055,922.94
负债					
应付清算款	-	-	-	14,387,806.29	14,387,806.29
应付赎回款	-	-	-	2,142,352.80	2,142,352.80
应付管理人报酬	-	-	-	345,613.40	345,613.40
应付托管费	-	-	-	57,602.22	57,602.22
应交税费	-	-	-	211.45	211.45
其他负债	-	-	-	3,151,627.86	3,151,627.86
负债总计	-	-	-	20,085,214.02	20,085,214.02
利率敏感度缺口	69,714,815.19	13,448,702.80	12,211,809.02	169,595,381.91	264,970,708.92

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	利率减少 25 基准点	321,344.57	335,121.05
	利率增加 25 基准点	-317,084.89	-330,369.01

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	307,987,718.31	74.03	188,206,227.40	71.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	79,105,999.46	19.01	62,416,944.07	23.56
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	387,093,717.77	93.05	250,623,171.47	94.59

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准增加	27,627,567.00	17,743,794.38

	5%		
	业绩比较基准减少	-27,627,567.00	-17,743,794.38
	5%		

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	323,462,721.90	202,858,377.80
第二层次	61,361,416.16	47,049,237.73
第三层次	2,269,579.71	715,555.94
合计	387,093,717.77	250,623,171.47

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	307,987,718.31	72.92
	其中：股票	307,987,718.31	72.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,105,999.46	18.73
	其中：债券	79,105,999.46	18.73
	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	5,995,615.61	1.42
	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	5,515,606.67	1.31
8	其他各项资产	23,748,345.68	5.62
9	合计	422,353,285.73	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,888,713.60	1.90
C	制造业	196,417,026.70	47.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,714,764.47	2.09
E	建筑业	24,688,268.05	5.93
F	批发和零售业	11,970,280.11	2.88
G	交通运输、仓储和邮政业	3,054,001.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,040,756.28	5.78
J	金融业	13,647,707.00	3.28
K	房地产业	2,057,790.00	0.49
L	租赁和商务服务业	2,617,796.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	8,459,841.63	2.03
N	水利、环境和公共设施管理业	117,917.46	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,476.01	0.01
R	文化、体育和娱乐业	4,284,380.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	307,987,718.31	74.03

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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601117	中国化学	756,600	6,264,648.00	1.51
2	002867	周大生	342,200	6,084,316.00	1.46
3	000951	中国重汽	348,600	5,873,910.00	1.41
4	603198	迎驾贡酒	85,700	5,467,660.00	1.31
5	300394	天孚通信	48,200	5,149,206.00	1.24
6	300026	红日药业	849,400	4,603,748.00	1.11
7	603708	家家悦	365,000	4,577,100.00	1.10
8	601965	中国汽研	207,300	4,280,745.00	1.03
9	300770	新媒股份	93,000	4,264,980.00	1.03
10	600079	人福医药	157,600	4,245,744.00	1.02
11	600248	陕建股份	869,600	4,147,992.00	1.00
12	601668	中国建筑	714,500	4,101,230.00	0.99
13	002154	报喜鸟	727,396	4,015,225.92	0.97
14	002444	巨星科技	181,800	3,977,784.00	0.96
15	600511	国药股份	101,200	3,931,620.00	0.95
16	688661	和林微纳	55,387	3,893,706.10	0.94
17	301185	鸥玛软件	116,500	3,846,830.00	0.92
18	601288	农业银行	1,085,000	3,830,050.00	0.92
19	000729	燕京啤酒	305,700	3,812,079.00	0.92
20	600566	济川药业	130,800	3,798,432.00	0.91
21	601390	中国中铁	499,800	3,788,484.00	0.91
22	002223	鱼跃医疗	104,600	3,764,554.00	0.90

23	600522	中天科技	230,900	3,673,619.00	0.88
24	600633	浙数文化	220,700	3,577,547.00	0.86
25	003029	吉大正元	108,800	3,530,560.00	0.85
26	002832	比音勒芬	99,100	3,509,131.00	0.84
27	605277	新亚电子	212,772	3,438,395.52	0.83
28	300132	青松股份	606,400	3,438,288.00	0.83
29	000739	普洛药业	193,700	3,436,238.00	0.83
30	600861	北京人力	147,700	3,426,640.00	0.82
31	600519	贵州茅台	1,975	3,339,725.00	0.80
32	603039	泛微网络	40,000	3,265,200.00	0.78
33	601601	中国太保	123,400	3,205,932.00	0.77
34	600557	康缘药业	112,100	3,078,266.00	0.74
35	603018	华设集团	342,432	2,996,280.00	0.72
36	300750	宁德时代	12,960	2,965,118.40	0.71
37	300627	华测导航	90,520	2,939,184.40	0.71
38	600801	华新水泥	237,600	2,934,360.00	0.71
39	601677	明泰铝业	203,800	2,828,744.00	0.68
40	000651	格力电器	77,300	2,822,223.00	0.68
41	002179	中航光电	62,038	2,813,423.30	0.68
42	000919	金陵药业	352,200	2,754,204.00	0.66
43	600926	杭州银行	230,000	2,702,500.00	0.65
44	600741	华域汽车	144,000	2,658,240.00	0.64
45	688601	力芯微	56,176	2,645,889.60	0.64
46	301308	江波龙	25,833	2,628,766.08	0.63
47	300280	紫天科技	54,800	2,617,796.00	0.63
48	600452	涪陵电力	118,500	2,521,680.00	0.61
49	601985	中国核电	354,800	2,501,340.00	0.60
50	688311	盟升电子	35,343	2,471,889.42	0.59
51	600938	中国海油	134,205	2,431,794.60	0.58
52	601636	旗滨集团	274,300	2,364,466.00	0.57
53	301155	海力风电	29,970	2,310,087.60	0.56
54	688120	华海清科	8,967	2,260,132.35	0.54
55	600188	兖矿能源	74,400	2,226,048.00	0.54
56	002864	盘龙药业	50,400	2,125,368.00	0.51
57	300257	开山股份	136,200	2,066,154.00	0.50
58	000736	中交地产	143,400	2,057,790.00	0.49
59	603128	华贸物流	225,500	2,054,305.00	0.49
60	002827	高争民爆	173,600	2,003,344.00	0.48
61	000661	长春高新	14,500	1,976,350.00	0.48
62	600919	江苏银行	266,000	1,955,100.00	0.47
63	600016	民生银行	521,100	1,954,125.00	0.47
64	688625	呈和科技	48,788	1,912,001.72	0.46
65	601800	中国交建	175,100	1,910,341.00	0.46

66	002833	弘亚数控	96,100	1,889,326.00	0.45
67	300982	苏文电能	31,000	1,877,360.00	0.45
68	002463	沪电股份	89,000	1,863,660.00	0.45
69	002430	杭氧股份	53,800	1,848,568.00	0.44
70	600348	华阳股份	233,700	1,848,567.00	0.44
71	688502	茂莱光学	9,658	1,838,244.00	0.44
72	002222	福晶科技	66,100	1,833,614.00	0.44
73	603566	普莱柯	77,600	1,804,200.00	0.43
74	300426	唐德影视	120,700	1,797,223.00	0.43
75	688501	青达环保	80,028	1,780,623.00	0.43
76	603000	人民网	60,100	1,754,920.00	0.42
77	688231	隆达股份	61,113	1,743,553.89	0.42
78	002737	葵花药业	70,400	1,713,536.00	0.41
79	603281	江瀚新材	55,020	1,699,017.60	0.41
80	301031	中熔电气	12,500	1,696,375.00	0.41
81	000425	徐工机械	247,600	1,676,252.00	0.40
82	688025	杰普特	19,005	1,660,086.75	0.40
83	002567	唐人神	248,400	1,651,860.00	0.40
84	603330	天洋新材	146,300	1,625,393.00	0.39
85	600150	中国船舶	48,700	1,602,717.00	0.39
86	300604	长川科技	33,700	1,600,413.00	0.38
87	688697	纽威数控	60,589	1,565,013.87	0.38
88	688420	美腾科技	40,278	1,559,966.94	0.37
89	000153	丰原药业	154,200	1,557,420.00	0.37
90	000657	中钨高新	158,730	1,538,093.70	0.37
91	600872	中炬高新	41,700	1,534,143.00	0.37
92	600183	生益科技	105,700	1,500,940.00	0.36
93	600502	安徽建工	276,500	1,459,920.00	0.35
94	600505	西昌电力	154,200	1,447,938.00	0.35
95	000156	华数传媒	165,700	1,441,590.00	0.35
96	000021	深科技	71,300	1,425,287.00	0.34
97	603306	华懋科技	49,100	1,424,882.00	0.34
98	688012	中微公司	9,048	1,415,559.60	0.34
99	002873	新天药业	102,300	1,383,096.00	0.33
100	601699	潞安环能	84,700	1,382,304.00	0.33
101	688400	凌云光	43,501	1,325,910.48	0.32
102	002918	蒙娜丽莎	84,700	1,307,768.00	0.31
103	301004	嘉益股份	33,500	1,299,800.00	0.31
104	688197	首药控股	27,154	1,294,159.64	0.31
105	603367	辰欣药业	84,100	1,276,638.00	0.31
106	300499	高澜股份	70,700	1,245,734.00	0.30
107	601126	四方股份	81,900	1,244,061.00	0.30
108	603170	宝立食品	58,300	1,239,458.00	0.30

109	603755	日辰股份	39,400	1,236,766.00	0.30
110	002975	博杰股份	27,700	1,208,828.00	0.29
111	300045	华力创通	102,700	1,191,320.00	0.29
112	301096	百诚医药	19,300	1,169,773.00	0.28
113	601003	柳钢股份	288,800	1,166,752.00	0.28
114	600461	洪城环境	139,100	1,136,447.00	0.27
115	601669	中国电建	199,999	1,131,994.34	0.27
116	600037	歌华有线	131,800	1,095,258.00	0.26
117	002608	江苏国信	141,600	1,071,912.00	0.26
118	002156	通富微电	47,100	1,064,460.00	0.26
119	600702	舍得酒业	8,500	1,053,575.00	0.25
120	300182	捷成股份	165,700	1,045,567.00	0.25
121	603520	司太立	62,500	1,042,500.00	0.25
122	688028	沃尔德	45,651	1,022,582.40	0.25
123	688273	麦澜德	27,306	1,010,595.06	0.24
124	601000	唐山港	283,200	999,696.00	0.24
125	002602	世纪华通	123,900	940,401.00	0.23
126	688776	国光电气	11,059	916,569.92	0.22
127	688682	霍莱沃	10,371	868,467.54	0.21
128	603061	金海通	5,900	698,855.00	0.17
129	300674	宇信科技	39,200	693,056.00	0.17
130	301191	菲菱科思	6,290	650,511.80	0.16
131	688195	腾景科技	7,906	422,417.58	0.10
132	688582	芯动联科	8,737	406,675.35	0.10
133	688655	迅捷兴	22,606	371,642.64	0.09
134	688443	智翔金泰	7,712	237,281.68	0.06
135	301291	明阳电气	4,866	157,867.01	0.04
136	301486	致尚科技	2,629	151,588.14	0.04
137	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
138	301262	海看股份	4,934	135,807.00	0.03
139	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
140	301397	溯联股份	2,746	115,825.40	0.03
141	688581	安杰思	885	108,006.71	0.03
142	688503	聚和材料	1,091	106,372.50	0.03
143	000888	峨眉山 A	8,800	100,848.00	0.02
144	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
145	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.02
146	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
147	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
148	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
149	688249	晶合集成	1,864	33,663.84	0.01
150	688472	阿特斯	1,405	23,941.20	0.01
151	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01

152	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.01
153	301311	昆船智能	757	22,316.36	0.01
154	688361	中科飞测	333	21,535.11	0.01
155	688469	中芯集成	3,926	21,239.66	0.01
156	301165	锐捷网络	319	19,688.68	0.00
157	301325	曼恩斯特	182	19,646.90	0.00
158	301301	川宁生物	2,118	18,977.28	0.00
159	301310	鑫宏业	269	17,600.67	0.00
160	688576	西山科技	132	15,894.12	0.00
161	688562	航天软件	706	15,750.86	0.00
162	688543	国科军工	280	14,854.00	0.00
163	301391	卡莱特	124	14,529.08	0.00
164	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
165	301383	天键股份	389	13,895.08	0.00
166	301399	英特科技	269	13,872.33	0.00
167	301358	湖南裕能	321	13,767.69	0.00
168	688593	新相微	903	13,174.77	0.00
169	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
170	301210	金杨股份	267	13,128.39	0.00
171	688458	美芯晟	141	12,797.16	0.00
172	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
173	301387	光大同创	269	12,201.84	0.00
174	688334	西高院	713	11,557.73	0.00
175	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
176	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
177	301307	美利信	353	11,246.58	0.00
178	301360	荣旗科技	121	11,204.60	0.00
179	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
180	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
181	688552	航天南湖	471	11,068.50	0.00
182	688146	中船特气	287	10,943.31	0.00
183	688352	颀中科技	890	10,742.30	0.00
184	688484	南芯科技	289	10,609.19	0.00
185	301303	真兰仪表	471	10,512.72	0.00
186	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
187	301408	华人健康	617	10,458.15	0.00
188	301332	德尔玛	742	10,187.66	0.00
189	301305	朗坤环境	514	10,120.66	0.00
190	688512	慧智微	527	10,097.32	0.00
191	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
192	301246	宏源药业	311	9,550.81	0.00
193	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
194	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00

195	688570	天玛智控	365	9,245.45	0.00
196	301335	天元宠物	384	9,154.56	0.00
197	688631	莱斯信息	303	9,050.61	0.00
198	688623	双元科技	103	8,939.37	0.00
199	688507	索辰科技	73	8,914.03	0.00
200	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
201	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
202	301328	维峰电子	152	8,654.88	0.00
203	301357	北方长龙	178	8,613.42	0.00
204	001287	中电港	397	8,344.94	0.00
205	301323	新莱福	211	8,304.96	0.00
206	301290	东星医疗	259	8,300.95	0.00
207	688433	华曙高科	257	8,095.50	0.00
208	301373	凌玮科技	253	8,058.05	0.00
209	301386	未来电器	327	7,779.33	0.00
210	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
211	301157	华塑科技	144	7,621.92	0.00
212	301281	科源制药	301	7,555.10	0.00
213	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
214	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
215	301203	国泰环保	202	6,948.80	0.00
216	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
217	688479	友车科技	233	6,871.17	0.00
218	601061	中信金属	879	6,662.82	0.00
219	301439	泓淋电力	389	6,574.10	0.00
220	301265	华新环保	557	6,472.34	0.00
221	603135	中重科技	314	5,617.46	0.00
222	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
223	301345	涛涛车业	106	4,943.84	0.00
224	601065	江盐集团	395	4,780.15	0.00
225	301267	华夏眼科	77	4,693.15	0.00
226	301349	信德新材	84	4,211.76	0.00
227	601133	柏诚股份	320	3,923.20	0.00
228	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
229	001328	登康口腔	127	3,237.23	0.00
230	001360	南矿集团	171	2,542.77	0.00
231	301388	欣灵电气	92	2,470.20	0.00
232	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
233	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
234	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
235	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
236	301283	聚胶股份	54	1,915.92	0.00
237	301273	瑞晨环保	58	1,818.88	0.00

238	301115	建科股份	65	1,485.90	0.00
239	301316	慧博云通	59	1,348.15	0.00
240	301309	万得凯	48	1,321.92	0.00
241	301389	隆扬电子	70	1,272.60	0.00
242	301161	唯万密封	46	1,063.06	0.00
243	301356	天振股份	38	832.20	0.00
244	301359	东南电子	28	713.44	0.00
245	301285	鸿日达	45	652.05	0.00
246	301296	新巨丰	38	641.44	0.00
247	603073	彩蝶实业	30	625.80	0.00
248	301276	嘉曼服饰	24	612.00	0.00
249	301361	众智科技	17	479.23	0.00
250	301223	中荣股份	18	336.96	0.00
251	688188	柏楚电子	1	188.56	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601117	中国化学	7,765,887.00	2.93
2	002867	周大生	5,655,896.50	2.13
3	300026	红日药业	5,213,401.00	1.97
4	603708	家家悦	4,746,472.00	1.79
5	300770	新媒股份	4,625,453.00	1.75
6	600248	陕建股份	4,446,381.00	1.68
7	002154	报喜鸟	4,211,631.68	1.59
8	600566	济川药业	4,009,217.00	1.51
9	688601	力芯微	3,958,124.75	1.49
10	601390	中国中铁	3,910,510.99	1.48
11	601288	农业银行	3,841,383.00	1.45
12	600801	华新水泥	3,793,496.68	1.43
13	003029	吉大正元	3,592,263.00	1.36
14	600522	中天科技	3,557,531.29	1.34
15	601677	明泰铝业	3,531,576.00	1.33
16	601668	中国建筑	3,505,322.00	1.32
17	600511	国药股份	3,495,283.00	1.32
18	600557	康缘药业	3,494,629.00	1.32
19	002864	盘龙药业	3,154,065.46	1.19
20	600633	浙数文化	2,985,145.00	1.13

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002979	雷赛智能	4,096,300.00	1.55
2	300395	菲利华	4,023,486.50	1.52
3	301035	润丰股份	3,703,016.40	1.40
4	688499	利元亨	3,180,949.94	1.20
5	600585	海螺水泥	2,821,875.95	1.06
6	301363	美好医疗	2,741,861.00	1.03
7	002436	兴森科技	2,740,174.00	1.03
8	688330	宏力达	2,589,912.83	0.98
9	301306	西测测试	2,533,934.89	0.96
10	688382	益方生物	2,490,544.67	0.94
11	600085	同仁堂	2,472,221.00	0.93
12	600660	福耀玻璃	2,433,400.00	0.92
13	300394	天孚通信	2,307,483.00	0.87
14	000799	酒鬼酒	2,224,044.00	0.84
15	688658	悦康药业	2,093,941.20	0.79
16	300031	宝通科技	2,065,585.00	0.78
17	605186	健麾信息	2,055,402.00	0.78
18	601965	中国汽研	2,019,310.00	0.76
19	603011	合锻智能	1,948,631.00	0.74
20	603267	鸿远电子	1,914,346.00	0.72

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	272,547,764.50
卖出股票收入（成交）总额	163,137,639.05

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,726,459.08	14.60
	其中：政策性金融债	60,726,459.08	14.60
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	18,379,540.38	4.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,105,999.46	19.01

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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018008	国开 1802	290,700	30,148,879.29	7.25
2	200205	20 国开 05	100,000	10,280,784.15	2.47
3	210402	21 农发 02	100,000	10,174,590.16	2.45
4	220308	22 进出 08	100,000	10,122,205.48	2.43
5	110059	浦发转债	35,120	3,796,200.66	0.91

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	48,353.34
2	应收清算款	2,392,663.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,307,328.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,748,345.68

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	3,796,200.66	0.91
2	113584	家悦转债	2,267,069.28	0.54
3	110079	杭银转债	1,888,543.38	0.45
4	128125	华阳转债	1,585,457.54	0.38
5	110062	烽火转债	1,582,003.70	0.38
6	113053	隆 22 转债	1,345,869.04	0.32
7	123107	温氏转债	1,250,936.43	0.30
8	127012	招路转债	1,171,027.47	0.28
9	127015	希望转债	1,061,997.50	0.26
10	110081	闻泰转债	715,060.25	0.17
11	110047	山鹰转债	602,519.99	0.14
12	110053	苏银转债	589,608.81	0.14
13	118022	锂科转债	499,750.16	0.12
14	113652	伟 22 转债	23,496.17	0.01

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
工银灵活 配置混合 A	42,021	3,838.50	46,941,729.71	29.10	114,355,908.34	70.90
工银灵活 配置混合 B	-	-	-	-	-	-
合计	42,021	3,838.50	46,941,729.71	29.10	114,355,908.34	70.90

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理 人所有从 业人员持 有本基金	工银灵活配置混合 A	878,070.28	0.54
	工银灵活配置混合 B	-	-
	合计	878,070.28	0.54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基 金投资和研 究部门负责 人持有本 开放式基金	工银灵活配置混合 A	10~50
	工银灵活配置混合 B	0
	合计	10~50
本基金基金 经理持有 本开放式 基金	工银灵活配置混合 A	50~100
	工银灵活配置混合 B	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银灵活配置混合 A	工银灵活配置混合 B
基金合同生效日 (2018 年 2 月 9 日)	181,435,430.11	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	107,235,124.04	-
本报告期基金总申购份额	82,712,016.27	-
减：本报告期基金总赎回份额	28,649,502.26	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	161,297,638.05	-

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人

基金管理人于 2023 年 1 月 14 日发布公告，李剑峰先生自 2023 年 1 月 12 日起担任公司首席投资官，张波先生自 2023 年 1 月 12 日起担任公司首席营销官。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	219,173,941.70	51.68	158,091.69	54.37	-
光大证券	1	151,782,210.02	35.79	94,302.13	32.43	-
东方证券	1	53,180,745.20	12.54	38,358.90	13.19	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经

营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

本报告期内本基金新增中信建投 1 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	8,618,393.72	100.00	532,000,000.00	42.46	-	-
光大证券	-	-	721,000,000.00	57.54	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 14 日
2	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	2023 年 1 月 14 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资中国电建非公开发行股票的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准工银瑞信保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日