

# 工银瑞信价值成长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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信价值成长混合型证券投资基金	
基金简称	工银价值成长混合	
基金主代码	014175	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 23 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	257,988,500.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银价值成长混合 A	工银价值成长混合 C
下属分级基金的交易代码	014175	014176
报告期末下属分级基金的份额总额	219,778,590.88 份	38,209,909.34 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选行业中具有综合比较优势的个股，在有效控制投资组合风险的前提下，追求基金资产长期稳定增值，力争实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	<p>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，判断国内及香港证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例。</p> <p>本基金基于对市场中长期投资趋势的判断，采取均衡风格配置，兼顾价值和成长风格，通过自上而下进行行业配置，并结合自下而上精选基本面优秀的个股，构建股票投资组合。在行业配置中，本基金将自上而下地进行行业遴选，从经济发展的不同阶段出发，把握中国经济发展方向和经济增长的变迁趋势，在分析行业所处产业环境、产业政策、产业竞争格局、景气周期等基础上判断各行业未来成长前景，采取适度均衡的行业配置策略，并适时进行动态调整，严格控制投资风险。</p> <p>本基金将通过定性分析和定量分析相结合的办法，以合理价格买入长期优质成长股，选择的投资标的更看重公司质地的优秀、业绩能够保持长期稳定增长预期以及股票估值合理，选择股票强调成长性与合理估值的动态平衡。重点关注成长性被低估的优秀公司，或稳定成长行业中优秀程度未被充分认知的公司，持续跟踪公司和行业</p>

	基本面及估值，以合理成本投资于内在价值持续增长的企业，分享盈利或估值提升带来的投资机会。本基金将通过港股通投资于香港股票市场。
业绩比较基准	65%×中证 800 指数收益率+5%×恒生指数收益率+30%×中债综合财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	秦一楠
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		赵桂才	谷澍

## 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基金管理人互联网网址	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)	
	工银价值成长混合 A	工银价值成长混合 C
本期已实现收益	-4,097,879.26	-839,866.72
本期利润	-2,982,891.41	-670,710.04

加权平均基金份额本期利润	-0.0131	-0.0167
本期加权平均净值利润率	-1.43%	-1.82%
本期基金份额净值增长率	-1.67%	-1.97%
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	-24,351,682.16	-4,493,660.10
期末可供分配基金份额利润	-0.1108	-0.1176
期末基金资产净值	195,426,908.72	33,716,249.24
期末基金份额净值	0.8892	0.8824
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	-11.08%	-11.76%

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

工银价值成长混合 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	2.02%	0.73%	0.84%	0.61%	1.18%	0.12%
过去三个月	-4.41%	0.72%	-3.00%	0.56%	-1.41%	0.16%

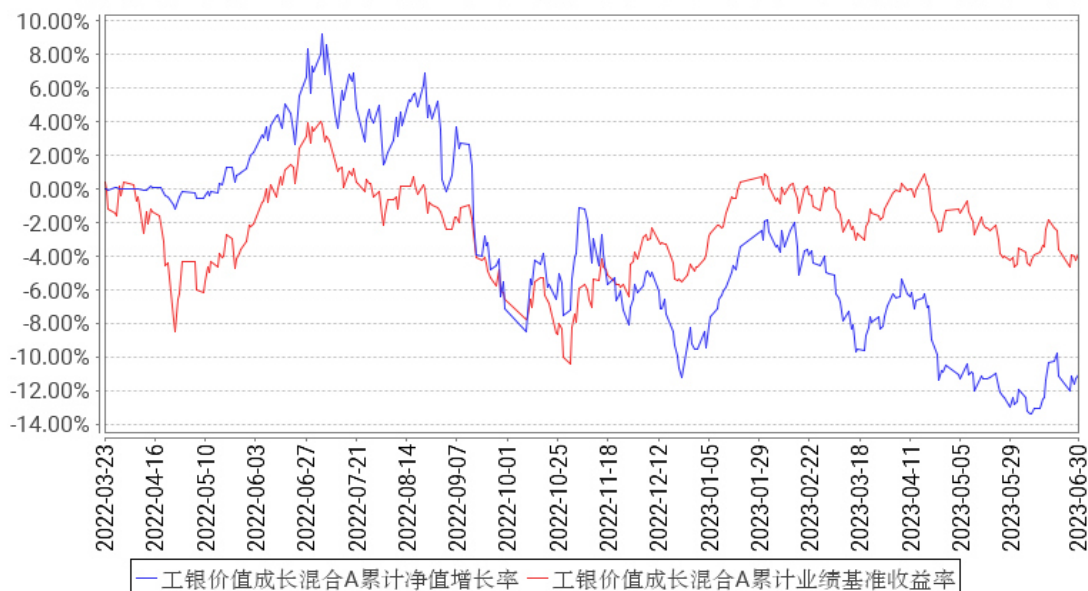
过去六个月	-1.67%	0.76%	0.84%	0.57%	-2.51%	0.19%
过去一年	-17.11%	1.01%	-7.28%	0.67%	-9.83%	0.34%
自基金合同生效起至今	-11.08%	0.95%	-3.86%	0.75%	-7.22%	0.20%

工银价值成长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.96%	0.73%	0.84%	0.61%	1.12%	0.12%
过去三个月	-4.55%	0.72%	-3.00%	0.56%	-1.55%	0.16%
过去六个月	-1.97%	0.76%	0.84%	0.57%	-2.81%	0.19%
过去一年	-17.60%	1.01%	-7.28%	0.67%	-10.32%	0.34%
自基金合同生效起至今	-11.76%	0.95%	-3.86%	0.75%	-7.90%	0.20%

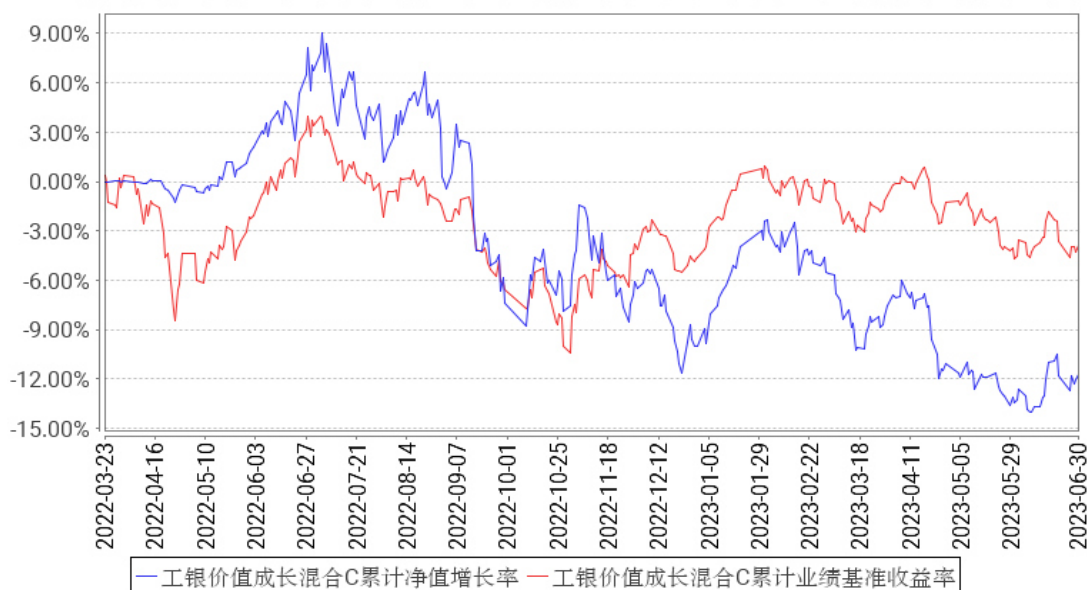
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

工银价值成长混合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





工银价值成长混合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 2022 年 03 月 23 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。

### 3.3 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		
何肖颀	权益投资部投资总监、基金经理兼任投资经理	2022 年 3 月 23 日	-	25 年	硕士研究生。曾任华夏证券研究所研究员，博时基金研究员、基金经理；2008 年加入工银瑞信，现任权益投资部投资总监、基金经理兼任投资经理。2014 年 3 月 6 日至今，担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理；2015 年 1 月 27 日至今，担任工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 2 日至今，担任工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金基金经理；2015 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 3 月 23 日至今，担任工银瑞信价值成长混合型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》的相关规定。

#### 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
何肖颀	公募基金	5	8,658,740,017.50	2014 年 3 月 6 日
	私募资产管理计划	2	10,991,099,374.77	2022 年 3 月 30 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	19,649,839,392.27	-

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 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

一季度，市场对于国内外经济的预期波动较大。对于国内经济，市场在春节餐饮和出行数据快速恢复下，形成了国内经济强劲复苏的预期。然而，节后经济数据表明，复工以来生产偏强、需求偏弱、出口压力较大、订单持续性不明朗、工资水平低位徘徊，市场对于国内经济恢复的预期滑向弱预期。海外加息预期的混乱：去年底到一月份，海外投资者在美国通胀放缓下对于美联储加息见顶、政策转向做出了过于乐观的预期。然而，美国通胀韧性较强，尽管有 2022 年持续、快速的加息，美国企业利润增长依然强劲，就业需求和工资水平韧性较强，房屋库存水平处于五年来低位。投资者在接受现实后又出现了大幅度的预期转向，最极端的预期为 23 年加息四次。3 月份高息环境下的中小银行危机带来了进一步的货币政策修正，市场加息预期回到了 23 年加息两次，即去年加息预期改变前的原点。上述对国内外宏观预期的大幅摆动，给市场带来了巨大的波动。

二季度，国内经济复苏力度持续低于市场预期，经济复苏相关产业链表现较弱。经济增长表

现疲弱，主要受需求不振的影响。地产方面，新房销售不佳，土地市场表现低迷，成交集中于头部城市，新开工持续放缓，保交楼进度慢于预期。基建方面，受限于地方政府财力，基建增速放缓。制造业投资增速持续放缓。消费端修复动能趋弱，终端消费普遍性强调性价比，房租价格承压。出口端在高基数下表现尚可。流动性方面相对宽松，信贷需求较为低迷。通胀方面，物价向上压力有限。政策端保持定力，六月中下旬开始出现积极变化。海外美国经济表现持续好于预期，企业和居民端杠杆率较疫情前改善明显，能够承受更长时间的高利率环境，市场对于海外货币政策转向的预期逐渐降低。

操作方面，主要增持电子、通信、地产，减持电力设备、煤炭、医药。

#### 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-1.67%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 0.84%，本基金 C 份额净值增长率为-1.97%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为 0.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A 股市场最困难的时期应该已经过去，未来机会大于风险，等待全社会信心恢复。一方面，市场对于经济复苏的预期已经充分调低，估值风险大幅降低。从强预期、弱现实到低预期、弱现实，市场对于经济复苏过于乐观的预期已经消散，对于高质量发展的政策导向有了更为深入的理解，对于地产行业困境、城投债务问题和地方财政压力的复杂难解有了更为充分的认知。当前，企业宏观杠杆率不低，且居民收入增速放缓，企业营收压力增大，经济休养生息、自然恢复需要更长的时间。从股价的角度看，与经济周期强相关的行业估值风险已经较为充分的出清。另一方面，经济运行的底部特征较为明显，在补库存需求和政策出台的共同支撑下，下半年经济复苏力度有望改善。PPI 在负值区间持续运行，库存水平已经临近历史最低，下半年有望迎来补库需求。同时，政策存在累积效应，继降息、家电消费、新能源汽车补贴政策之后，互联网行业规范已经步入尾声，未来对于地产、城投和地方财政的规范性政策将更加清晰，减轻市场对于不确定性的担忧。

未来重点关注以下三个方面：随着政策刺激逐渐累加和企业库存去化逐渐步入尾声，国内经济增长的动能有望得到改善，经济复苏相关的产业链存在一定的修复机会。考虑到国内企业和居民的杠杆率仍处于高位，企业和居民自身资产负债表的修复尚需时间，现金流稳定、分红率可观的标的具有较高对冲不确定性的价值。从更长周期看，调结构已经成为市场的共识，具备潜在增长空间且与经济增长相关度较低的行业仍是重点关注的方向。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利

益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：工银瑞信价值成长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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	79,524,904.23	58,201,421.69
结算备付金		45,747.97	609,408.62
存出保证金		86,087.71	109,960.68
交易性金融资产	6.4.7.2	146,622,053.16	183,427,796.87
其中：股票投资		146,622,053.16	183,191,063.67
基金投资		-	-
债券投资		-	236,733.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,726,131.13	8,836,004.08
应收股利		-	-
应收申购款		2,444.92	4,369.22
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		230,007,369.12	251,188,961.16
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.09	1.63
应付赎回款		231,910.92	386,835.82
应付管理人报酬		281,388.94	328,723.97
应付托管费		46,898.17	54,787.33
应付销售服务费		16,642.18	20,039.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	2.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	287,369.86	277,824.39
负债合计		864,211.16	1,068,214.94
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	257,988,500.22	276,782,539.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-28,845,342.26	-26,661,793.56
净资产合计		229,143,157.96	250,120,746.22
负债和净资产总计		230,007,369.12	251,188,961.16

注：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 3 月 23 日。

2、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额为 257,988,500.22 份，其中工银价值成长混合 A 基金份额总额为 219,778,590.88 份，基金份额净值 0.8892 元；工银价值成长混合 C 基金份额总额为 38,209,909.34 份，基金份额净值 0.8824 元。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信价值成长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3月23日（基金 合同生效日）至2022年6 月30日
<b>一、营业总收入</b>		-1,314,573.12	34,626,939.00
1. 利息收入		174,004.06	1,455,798.16

其中：存款利息收入	6.4.7.13	174,004.06	727,452.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	728,345.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,795,573.00	6,972,023.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,143,620.31	4,692,745.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	130,233.30	40.99
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	1,217,814.01	2,279,236.77
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	1,284,144.53	25,161,865.25
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	22,851.29	1,037,252.04
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,339,028.33</b>	<b>3,125,944.20</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,832,853.97	2,445,856.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	305,475.63	407,642.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	109,536.90	212,587.45
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.34	0.16
8. 其他费用	6.4.7.23	91,161.49	59,857.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,653,601.45</b>	<b>31,500,994.80</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,653,601.45</b>	<b>31,500,994.80</b>



五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,653,601.45	31,500,994.80

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信价值成长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）	276,782,539.78	-	-26,661,793.56	250,120,746.22
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）	276,782,539.78	-	-26,661,793.56	250,120,746.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,794,039.56	-	-2,183,548.70	-20,977,588.26
（一）、综合收益总额	-	-	-3,653,601.45	-3,653,601.45
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-18,794,039.56	-	1,470,052.75	-17,323,986.81
其中：1. 基金申购款	5,812,416.87	-	-504,354.67	5,308,062.20
2. 基金赎回款	-24,606,456.43	-	1,974,407.42	-22,632,049.01
（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)	257,988,500.22	-	-28,845,342.26	229,143,157.96
项目	上年度可比期间			
	2022年3月23日(基金合同生效日)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)	-	-	-	-
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)	755,378,545.11	-	-	755,378,545.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-401,539,074.80	-	25,599,613.32	-375,939,461.48
(一)、综合收益总额	-	-	31,500,994.80	31,500,994.80
(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)	-401,539,074.80	-	-5,901,381.48	-407,440,456.28
其中: 1. 基金申购款	6,503,135.16	-	133,386.38	6,636,521.54
2. 基金赎回款	-408,042,209.96	-	-6,034,767.86	-414,076,977.82
(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)	353,839,470.31	-	25,599,613.32	379,439,083.63

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:

赵桂才

基金管理人负责人

郝炜

主管会计工作负责人

关亚君

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

工银瑞信价值成长混合型证券投资基金（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]3425号《关于准予工银瑞信价值成长混合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2022年3月7日至2022年3月18日向社会公开发行人募集，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（2022）验字第60802052\_A08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2022年3月23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755,279,629.54元，折合755,279,629.54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98,915.57元，折合98,915.57份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币755,378,545.11元，折合755,378,545.11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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

### 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。

#### (5) 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	79,524,904.23
等于：本金	79,508,430.96
加：应计利息	16,473.27
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	79,524,904.23

#### 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		159,481,557.90	-	146,622,053.16	-12,859,504.74
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		159,481,557.90	-	146,622,053.16	-12,859,504.74

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	367.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	152,699.36
其中：交易所市场	152,699.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	74,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	287,369.86

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 工银价值成长混合 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	235,815,939.27	235,815,939.27
本期申购	3,477,348.49	3,477,348.49
本期赎回（以“-”号填列）	-19,514,696.88	-19,514,696.88
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	219,778,590.88	219,778,590.88

## 工银价值成长混合 C

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	40,966,600.51	40,966,600.51
本期申购	2,335,068.38	2,335,068.38
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,091,759.55	-5,091,759.55
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	38,209,909.34	38,209,909.34

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

##### 工银价值成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,413,323.62	-19,154,107.61	-22,567,431.23
本期利润	-4,097,879.26	1,114,987.85	-2,982,891.41
本期基金份额交易产生的变动数	327,749.62	870,890.86	1,198,640.48
其中：基金申购款	-86,322.45	-245,064.58	-331,387.03
基金赎回款	414,072.07	1,115,955.44	1,530,027.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,183,453.26	-17,168,228.90	-24,351,682.16

##### 工银价值成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-779,421.79	-3,314,940.54	-4,094,362.33
本期利润	-839,866.72	169,156.68	-670,710.04
本期基金份额交易产生的变动数	96,989.93	174,422.34	271,412.27
其中：基金申购款	-54,438.38	-118,529.26	-172,967.64
基金赎回款	151,428.31	292,951.60	444,379.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,522,298.58	-2,971,361.52	-4,493,660.10

#### 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	169,199.79

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	4,082.76
其他	721.51
合计	174,004.06

#### 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	-4,143,620.31
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	-4,143,620.31

##### 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	258,031,597.41
减：卖出股票成本总额	261,542,813.12
减：交易费用	632,404.60
买卖股票差价收入	-4,143,620.31

##### 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	92.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	130,140.60
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	130,233.30

##### 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	366,983.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	236,700.00
减：应计利息总额	128.66
减：交易费用	14.67
买卖债券差价收入	130,140.60

#### 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	1,217,814.01
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	1,217,814.01

## 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	1,284,144.53
股票投资	1,284,144.53
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,284,144.53

## 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	22,141.67
基金转换费收入	709.62
合计	22,851.29

## 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	-
银行费用	6,561.05
港股通证券组合费	297.88
合计	91,161.49

#### 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
中国农业银行股份有限公司	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 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,832,853.97	2,445,856.42
其中：支付销售机构的客户维护费	875,966.90	1,167,701.17

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 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，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	305,475.63	407,642.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期
--------------	----

名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银价值成长混合 A	工银价值成长混合 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	496.48	496.48
中国工商银行股份有限公司	-	5,614.47	5,614.47
中国农业银行股份有限公司	-	87,565.02	87,565.02
合计	-	93,675.97	93,675.97
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银价值成长混合 A	工银价值成长混合 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	1,650.46	1,650.46
中国工商银行股份有限公司	-	6,194.42	6,194.42
中国农业银行股份有限公司	-	184,381.27	184,381.27
合计	-	192,226.15	192,226.15

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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3月23日(基金合同生效日)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
中国农业银行股份有限公司	79,524,904.23	169,199.79	48,470,815.87	666,207.60

#### 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
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	3,078	82,121.04	82,121.04	-
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	1,419	81,819.54	81,819.54	-
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	3,808	76,121.92	76,121.92	-



		日								
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	1,319	48,671.10	48,671.10	-
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	1,724	44,513.68	44,513.68	-
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	1,308	25,976.88	23,622.48	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	2,033	10,165.00	18,215.68	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	246	7,281.60	17,569.32	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	891	9,890.10	15,182.64	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	2,698	15,351.62	14,596.18	-
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	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	216	5,097.60	13,968.72	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	123	9,446.40	13,277.85	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	294	6,988.38	12,609.66	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	173	11,639.44	11,319.39	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股锁定	135.80	120.41	86	11,678.80	10,355.26	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	453	5,744.04	10,106.43	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	445	11,926.00	9,932.40	-

		日									
301387	光大同创	2023年 4月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	214	12,480.48	9,707.04		-
301408	华人健康	2023年 2月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	559	9,078.16	9,475.05		-
301141	中科磁业	2023年 3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	218	8,981.60	9,306.42		-
301315	威士顿	2023年 6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	179	5,779.91	9,150.48		-
301395	仁信新材	2023年 6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	342	9,124.56	9,124.56		-
301486	致尚科技	2023年 6月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	158	9,110.28	9,110.28		-
301360	荣旗科技	2023年 4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	98	7,044.24	9,074.80		-
301307	美利信	2023年 4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	284	9,184.56	9,048.24		-
301429	森泰股份	2023年 4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	427	12,276.25	8,975.54		-
301291	明阳电气	2023年 6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	288	10,981.44	8,936.64		-
301383	天键股份	2023年 5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	250	11,540.00	8,930.00		-
301399	英特科技	2023年 5月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	173	7,610.27	8,921.61		-
688146	中船特气	2023年 4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	231	8,350.65	8,808.03		-
688352	硕中科技	2023年 4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	713	8,627.30	8,605.91		-
301246	宏源药	2023年	6个月	新股锁	50.00	30.71	280	14,000.00	8,598.80		-

	业	3月10日		定							
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	581	6,495.58	8,476.79		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	424	8,475.76	8,475.76		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	258	6,140.40	8,472.72		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	225	8,997.75	8,259.75		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	91	6,825.00	8,259.16		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	339	7,410.54	8,085.15		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	314	9,489.08	8,007.00		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	240	8,558.40	7,982.40		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	153	5,355.00	7,838.19		-
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		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	325	6,880.25	7,637.50		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	154	8,913.52	7,572.18		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	228	7,690.44	7,261.80		-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	143	7,150.00	6,919.77		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	361	7,552.12	6,916.76		-
301332	德尔玛	2023年	6个月	新股锁	14.81	13.73	498	7,375.38	6,837.54		-

		5月9日		定							
688581	安杰思	2023年 5月12 日	6个月	新股锁 定	125.80	118.03	57	7,170.60	6,727.71		-
301157	华塑科 技	2023年 3月1日	6个月	新股锁 定	56.50	52.93	126	7,119.00	6,669.18		-
001287	中电港	2023年 3月30 日	6个月	新股锁 定	11.88	21.02	314	3,730.32	6,600.28		-
301305	朗坤环 境	2023年 5月15 日	6个月	新股锁 定	25.25	19.69	331	8,357.75	6,517.39		-
301386	未来电 器	2023年 3月21 日	6个月	新股锁 定	29.99	23.79	272	8,157.28	6,470.88		-
688433	华曙高 科	2023年 4月7日	6个月	新股锁 定	26.66	31.50	203	5,411.98	6,394.50		-
300804	广康生 化	2023年 6月15 日	6个月	新股锁 定	42.45	32.97	193	8,192.85	6,363.21		-
301397	溯联股 份	2023年 6月15 日	6个月	新股锁 定	53.27	40.20	157	8,363.39	6,311.40		-
301232	飞沃科 技	2023年 6月8日	6个月	新股锁 定	72.50	58.42	107	7,757.50	6,250.94		-
301428	世纪恒 通	2023年 5月10 日	6个月	新股锁 定	26.35	30.60	201	5,296.35	6,150.60		-
301355	南王科 技	2023年 6月2日	6个月	新股锁 定	17.55	16.75	361	6,335.55	6,046.75		-
688570	天玛智 控	2023年 5月29 日	6个月	新股锁 定	30.26	25.33	235	7,111.10	5,952.55		-
301439	泓淋电 力	2023年 3月10 日	6个月	新股锁 定	19.99	16.90	351	7,016.49	5,931.90		-
301376	致欧科 技	2023年 6月14 日	6个月	新股锁 定	24.66	22.51	259	6,386.94	5,830.09		-
301281	科源制 药	2023年 3月28 日	6个月	新股锁 定	31.61	25.10	232	7,333.88	5,823.20		-
301170	锡南科 技	2023年 6月16	6个月	新股锁 定	34.00	34.93	163	5,542.00	5,693.59		-

		日									
301203	国泰环 保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	46.13	34.40	165	7,611.45	5,676.00		-
688623	双元科 技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定	125.88	86.79	64	8,056.32	5,554.56		-
301261	恒工精 密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定	36.90	36.90	147	5,424.30	5,424.30		-
301337	亚华电 子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定	32.60	30.37	177	5,770.20	5,375.49		-
601061	中信金 属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定	6.58	7.58	696	4,579.68	5,275.68		-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定	39.06	39.36	134	5,234.04	5,274.24		-
301202	朗威股 份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定	25.82	25.82	192	4,957.44	4,957.44		-
688479	友车科 技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定	33.99	29.49	158	5,370.42	4,659.42		-
301345	涛涛车 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定	73.45	46.64	97	7,124.65	4,524.08		-
001380	华纬科 技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定	28.84	30.78	144	4,152.96	4,432.32		-
603135	中重科 技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定	17.80	17.89	247	4,396.60	4,418.83		-
601133	柏诚股 份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	11.66	12.26	254	2,961.64	3,114.04		-
601065	江盐集 团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	10.36	11.84	261	2,703.96	3,090.24		-
001328	登康口 腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定	20.68	25.49	100	2,068.00	2,549.00		-
001282	三联锻 造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定	27.93	33.03	76	2,122.68	2,510.28		-

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	-
001360	南矿集团	2023年 3月31 日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	137	2,107.06	2,037.19	-
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	-
603125	常青科技	2023年 3月30 日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	78	2,026.44	1,913.34	-
001367	海森药业	2023年 3月30 日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	45	2,001.60	1,776.60	-

#### 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	-	-
AAA 以下	-	236,733.20
未评级	-	-
合计	-	236,733.20

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时, 本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致, 并咨询会计师事务所意见后, 可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制, 最大限度保护基金份额持有人利益。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	79,524,904.23	-	-	-	79,524,904.23
结算备付金	45,747.97	-	-	-	45,747.97

存出保证金	86,087.71	-	-	-	86,087.71
交易性金融资产	-	-	-	-146,622,053.16	146,622,053.16
应收清算款	-	-	-	3,726,131.13	3,726,131.13
应收申购款	-	-	-	2,444.92	2,444.92
资产总计	79,656,739.91	-	-	-150,350,629.21	230,007,369.12
负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1.09	1.09
应付赎回款	-	-	-	231,910.92	231,910.92
应付管理人报酬	-	-	-	281,388.94	281,388.94
应付托管费	-	-	-	46,898.17	46,898.17
应付销售服务费	-	-	-	16,642.18	16,642.18
其他负债	-	-	-	287,369.86	287,369.86
负债总计	-	-	-	864,211.16	864,211.16
利率敏感度缺口	79,656,739.91	-	-	-149,486,418.05	229,143,157.96
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	58,201,421.69	-	-	-	58,201,421.69
结算备付金	609,408.62	-	-	-	609,408.62
存出保证金	109,960.68	-	-	-	109,960.68
交易性金融资产	-	-	236,733.20	183,191,063.67	183,427,796.87
应收清算款	-	-	-	8,836,004.08	8,836,004.08
应收申购款	-	-	-	4,369.22	4,369.22
资产总计	58,920,790.99	-	236,733.20	192,031,436.97	251,188,961.16
负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1.63	1.63
应付赎回款	-	-	-	386,835.82	386,835.82
应付管理人报酬	-	-	-	328,723.97	328,723.97
应付托管费	-	-	-	54,787.33	54,787.33
应付销售服务费	-	-	-	20,039.47	20,039.47
应交税费	-	-	-	2.33	2.33
其他负债	-	-	-	277,824.39	277,824.39
负债总计	-	-	-	1,068,214.94	1,068,214.94
利率敏感度缺口	58,920,790.99	-	236,733.20	190,963,222.03	250,120,746.22

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	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	-	3,375.78
	利率增加 25 基准点	-	-3,319.87

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,927,218.00	-	4,927,218.00
资产合计	-	4,927,218.00	-	4,927,218.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	4,927,218.00	-	4,927,218.00
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,517,240.00	-	7,517,240.00
资产合计	-	7,517,240.00	-	7,517,240.00

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,517,240.00	-	7,517,240.00

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇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	所有外币相对人民币升值 5%	246,360.90	375,862.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-246,360.90	-375,862.00

#### 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	146,622,053.16	63.99	183,191,063.67	73.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	236,733.20	0.09

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	146,622,053.16	63.99	183,427,796.87	73.34

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 5%	13,120,737.84	9,931,386.92
	业绩比较基准减少 5%	-13,120,737.84	-9,931,386.92

#### 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	145,628,725.99	182,081,413.91
第二层次	370,339.62	236,733.20
第三层次	622,987.55	1,109,649.76
合计	146,622,053.16	183,427,796.87

#### 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	146,622,053.16	63.75
	其中：股票	146,622,053.16	63.75
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	79,570,652.20	34.59
8	其他各项资产	3,814,663.76	1.66
9	合计	230,007,369.12	100.00

注：1、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。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,927,218.00 元，占期末资产净值比例为 2.15%。

## 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	8,848,452.32	3.86
C	制造业	103,391,722.62	45.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	391,397.47	0.17
E	建筑业	5,327,945.55	2.33
F	批发和零售业	27,181.10	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,076,408.39	3.96
J	金融业	1,139,320.00	0.50
K	房地产业	7,651,499.00	3.34
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,968,326.00	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	12,193.39	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,569.32	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,842,820.00	1.24
S	综合	-	-
	合计	141,694,835.16	61.84

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

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务 Communication Services	4,402,512.00	1.92

非必需消费品 Consumer Discretionary	524,706.00	0.23
必需消费品 Consumer Staples	-	-
能源 Energy	-	-
金融 Financials	-	-
保健 Health Care	-	-
工业 Industrials	-	-
信息技术 Information Technology	-	-
材料 Materials	-	-
房地产 Real Estate	-	-
公用事业 Utilities	-	-
合计	4,927,218.00	2.15

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	000063	中兴通讯	247,400	11,266,596.00	4.92
2	002415	海康威视	196,200	6,496,182.00	2.83
3	002594	比亚迪	23,600	6,095,172.00	2.66
4	300274	阳光电源	47,700	5,563,251.00	2.43
5	600820	隧道股份	885,600	5,322,456.00	2.32
6	002179	中航光电	115,050	5,217,517.50	2.28
7	00700	腾讯控股	14,400	4,402,512.00	1.92
8	600528	中铁工业	401,600	3,967,808.00	1.73
9	600489	中金黄金	373,404	3,857,263.32	1.68
10	300750	宁德时代	16,340	3,738,428.60	1.63
11	600875	东方电气	185,000	3,450,250.00	1.51
12	001979	招商蛇口	259,300	3,378,679.00	1.47
13	000069	华侨城 A	694,400	3,055,360.00	1.33
14	002475	立讯精密	92,800	3,011,360.00	1.31
15	300450	先导智能	79,200	2,864,664.00	1.25
16	300316	晶盛机电	38,200	2,708,380.00	1.18
17	600941	中国移动	28,200	2,631,060.00	1.15
18	600426	华鲁恒升	77,100	2,361,573.00	1.03
19	603986	兆易创新	22,200	2,358,750.00	1.03
20	000021	深科技	115,300	2,304,847.00	1.01
21	000651	格力电器	62,100	2,267,271.00	0.99
22	000333	美的集团	38,300	2,256,636.00	0.98
23	605589	圣泉集团	103,500	2,250,090.00	0.98



24	601899	紫金矿业	196,100	2,229,657.00	0.97
25	002881	美格智能	62,500	2,134,375.00	0.93
26	600559	老白干酒	85,000	2,083,350.00	0.91
27	002236	大华股份	101,900	2,012,525.00	0.88
28	600309	万华化学	22,600	1,985,184.00	0.87
29	688329	艾隆科技	60,562	1,962,208.80	0.86
30	600132	重庆啤酒	20,600	1,898,496.00	0.83
31	601928	凤凰传媒	164,100	1,870,740.00	0.82
32	003029	吉大正元	55,100	1,787,995.00	0.78
33	601225	陕西煤业	93,600	1,702,584.00	0.74
34	000581	威孚高科	107,100	1,686,825.00	0.74
35	688518	联赢激光	59,103	1,646,609.58	0.72
36	300770	新媒股份	33,800	1,550,068.00	0.68
37	603259	药明康德	24,600	1,532,826.00	0.67
38	688036	传音控股	10,320	1,517,040.00	0.66
39	301004	嘉益股份	38,600	1,497,680.00	0.65
40	002833	弘亚数控	75,000	1,474,500.00	0.64
41	002444	巨星科技	66,000	1,444,080.00	0.63
42	300759	康龙化成	37,500	1,435,500.00	0.63
43	002812	恩捷股份	13,400	1,291,090.00	0.56
44	600325	华发股份	123,600	1,217,460.00	0.53
45	002139	拓邦股份	92,800	1,211,040.00	0.53
46	601208	东材科技	93,600	1,188,720.00	0.52
47	300002	神州泰岳	81,600	1,142,400.00	0.50
48	603667	五洲新春	76,700	1,141,296.00	0.50
49	300033	同花顺	6,500	1,139,320.00	0.50
50	600584	长电科技	35,900	1,119,003.00	0.49
51	002782	可立克	70,300	1,074,887.00	0.47
52	600547	山东黄金	45,100	1,058,948.00	0.46
53	600989	宝丰能源	80,100	1,010,061.00	0.44
54	601098	中南传媒	83,800	972,080.00	0.42
55	000830	鲁西化工	87,700	926,112.00	0.40
56	688052	纳芯微	5,349	847,121.13	0.37
57	601865	福莱特	21,600	831,816.00	0.36
58	002138	顺络电子	23,700	566,667.00	0.25
59	300570	太辰光	10,100	552,571.00	0.24
60	02015	理想汽车-W	4,200	524,706.00	0.23
61	603662	柯力传感	12,600	463,680.00	0.20
62	688018	乐鑫科技	3,466	449,956.12	0.20
63	300680	隆盛科技	16,600	412,842.00	0.18
64	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.17
65	002230	科大讯飞	5,300	360,188.00	0.16
66	300811	铂科新材	4,540	269,857.60	0.12

67	002737	葵花药业	11,000	267,740.00	0.12
68	688475	萤石网络	5,815	249,230.90	0.11
69	688515	裕太微	1,434	246,160.44	0.11
70	600801	华新水泥	16,500	203,775.00	0.09
71	603258	电魂网络	3,300	140,283.00	0.06
72	601728	中国电信	20,500	115,415.00	0.05
73	301395	仁信新材	3,420	91,245.60	0.04
74	301486	致尚科技	1,577	90,929.82	0.04
75	301292	海科新源	4,232	84,597.68	0.04
76	301261	恒工精密	1,466	54,095.40	0.02
77	301202	朗威股份	1,916	49,471.12	0.02
78	688249	晶合集成	1,308	23,622.48	0.01
79	301301	川宁生物	2,033	18,215.68	0.01
80	301293	三博脑科	246	17,569.32	0.01
81	688472	阿特斯	891	15,182.64	0.01
82	688469	中芯集成	2,698	14,596.18	0.01
83	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
84	688361	中科飞测	216	13,968.72	0.01
85	301325	曼恩斯特	123	13,277.85	0.01
86	301358	湖南裕能	294	12,609.66	0.01
87	301310	鑫宏业	173	11,319.39	0.00
88	688576	西山科技	86	10,355.26	0.00
89	688562	航天软件	453	10,106.43	0.00
90	301303	真兰仪表	445	9,932.40	0.00
91	301387	光大同创	214	9,707.04	0.00
92	301408	华人健康	559	9,475.05	0.00
93	301141	中科磁业	218	9,306.42	0.00
94	301315	威士顿	179	9,150.48	0.00
95	301360	荣旗科技	98	9,074.80	0.00
96	301307	美利信	284	9,048.24	0.00
97	301429	森泰股份	427	8,975.54	0.00
98	301291	明阳电气	288	8,936.64	0.00
99	301383	天键股份	250	8,930.00	0.00
100	301399	英特科技	173	8,921.61	0.00
101	688146	中船特气	231	8,808.03	0.00
102	688352	颀中科技	713	8,605.91	0.00
103	301246	宏源药业	280	8,598.80	0.00
104	688593	新相微	581	8,476.79	0.00
105	301382	蜂助手	258	8,472.72	0.00
106	688484	南芯科技	225	8,259.75	0.00
107	688458	美芯晟	91	8,259.16	0.00
108	688523	航天环宇	339	8,085.15	0.00
109	301262	海看股份	314	8,007.00	0.00

110	301225	恒勃股份	240	7,982.40	0.00
111	688535	华海诚科	153	7,838.19	0.00
112	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
113	688552	航天南湖	325	7,637.50	0.00
114	301210	金杨股份	154	7,572.18	0.00
115	301373	凌玮科技	228	7,261.80	0.00
116	301357	北方长龙	143	6,919.77	0.00
117	688512	慧智微	361	6,916.76	0.00
118	301332	德尔玛	498	6,837.54	0.00
119	688581	安杰思	57	6,727.71	0.00
120	301157	华塑科技	126	6,669.18	0.00
121	001287	中电港	314	6,600.28	0.00
122	301305	朗坤环境	331	6,517.39	0.00
123	301386	未来电器	272	6,470.88	0.00
124	688433	华曙高科	203	6,394.50	0.00
125	300804	广康生化	193	6,363.21	0.00
126	301397	溯联股份	157	6,311.40	0.00
127	301232	飞沃科技	107	6,250.94	0.00
128	301428	世纪恒通	201	6,150.60	0.00
129	301355	南王科技	361	6,046.75	0.00
130	688570	天玛智控	235	5,952.55	0.00
131	301439	泓淋电力	351	5,931.90	0.00
132	301376	致欧科技	259	5,830.09	0.00
133	301281	科源制药	232	5,823.20	0.00
134	301170	锡南科技	163	5,693.59	0.00
135	301203	国泰环保	165	5,676.00	0.00
136	688623	双元科技	64	5,554.56	0.00
137	301337	亚华电子	177	5,375.49	0.00
138	601061	中信金属	696	5,275.68	0.00
139	301323	新莱福	134	5,274.24	0.00
140	688479	友车科技	158	4,659.42	0.00
141	301345	涛涛车业	97	4,524.08	0.00
142	001380	华纬科技	144	4,432.32	0.00
143	603135	中重科技	247	4,418.83	0.00
144	601133	柏诚股份	254	3,114.04	0.00
145	601065	江盐集团	261	3,090.24	0.00
146	001328	登康口腔	100	2,549.00	0.00
147	001282	三联锻造	76	2,510.28	0.00
148	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
149	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
150	001360	南矿集团	137	2,037.19	0.00
151	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
152	603125	常青科技	78	1,913.34	0.00

153	001367	海森药业	45	1,776.60	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	000063	中兴通讯	8,906,785.00	3.56
2	002415	海康威视	8,385,974.00	3.35
3	000069	华侨城 A	7,513,151.37	3.00
4	002230	科大讯飞	7,078,848.00	2.83
5	688561	奇安信	5,969,633.06	2.39
6	603927	中科软	5,386,686.04	2.15
7	001979	招商蛇口	5,289,516.00	2.11
8	300680	隆盛科技	5,259,067.00	2.10
9	688329	艾隆科技	5,091,060.90	2.04
10	603986	兆易创新	5,019,253.22	2.01
11	002179	中航光电	5,011,958.60	2.00
12	300059	东方财富	4,984,185.80	1.99
13	00700	腾讯控股	4,884,770.27	1.95
14	002152	广电运通	4,562,349.90	1.82
15	002475	立讯精密	4,191,266.00	1.68
16	003029	吉大正元	4,061,676.50	1.62
17	600489	中金黄金	4,035,622.92	1.61
18	600528	中铁工业	3,848,531.00	1.54
19	688036	传音控股	3,491,942.71	1.40
20	600820	隧道股份	3,399,973.00	1.36

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	600188	兖矿能源	5,792,355.00	2.32
1	01171	兖矿能源	4,205,592.26	1.68
2	002709	天赐材料	8,656,204.00	3.46
3	000400	许继电气	8,342,260.70	3.34
4	002230	科大讯飞	8,039,032.00	3.21
5	600031	三一重工	7,171,791.00	2.87
6	603927	中科软	6,823,802.60	2.73
7	002475	立讯精密	6,804,945.00	2.72
8	600559	老白干酒	6,413,935.91	2.56

9	688518	联赢激光	5,387,123.78	2.15
10	000538	云南白药	5,304,269.20	2.12
11	688561	奇安信	5,266,207.43	2.11
12	300316	晶盛机电	5,134,816.00	2.05
13	600089	特变电工	5,001,571.00	2.00
14	002152	广电运通	4,753,150.00	1.90
15	300059	东方财富	4,483,604.16	1.79
16	300360	炬华科技	4,445,722.10	1.78
17	600066	宇通客车	4,382,897.00	1.75
18	601088	中国神华	4,338,228.00	1.73
19	300680	隆盛科技	4,245,746.00	1.70
20	603035	常熟汽饰	4,007,111.66	1.60

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	223,689,658.08
卖出股票收入（成交）总额	258,031,597.41

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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	86,087.71
2	应收清算款	3,726,131.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,444.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,814,663.76

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 (%)
工银价值 成长混合 A	6,745	32,583.93	5,004,003.72	2.28	214,774,587.16	97.72
工银价值 成长混合 C	1,386	27,568.48	1,000,240.00	2.62	37,209,669.34	97.38
合计	8,131	31,729.00	6,004,243.72	2.33	251,984,256.50	97.67

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 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	工银价值成长混合 A	0
	工银价值成长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	工银价值成长混合 A	0
	工银价值成长混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银价值成长混合 A	工银价值成长混合 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 23 日) 基金份额总额	578,846,125.98	176,532,419.13
本报告期期初基金份 额总额	235,815,939.27	40,966,600.51
本报告期基金总申购 份额	3,477,348.49	2,335,068.38
减：本报告期基金总 赎回份额	19,514,696.88	5,091,759.55
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	219,778,590.88	38,209,909.34

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

无。

### 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 (%)	
中信证券	2	262,218,320.	55.25	188,638.42	57.99	-



		50				
银河证券	1	180,532,583.68	38.04	113,972.46	35.04	-
国盛证券	3	28,160,641.19	5.93	20,312.55	6.24	-
国泰君安	1	3,308,202.86	0.70	2,055.31	0.63	-
华泰证券	2	421,952.18	0.09	304.34	0.09	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

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

(2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

## 2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	366,983.93	100.00	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证	-	-	-	-	-	-

券						
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国新证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 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	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下 部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 4 日
4	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下 部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信价值成长混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信价值成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信价值成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信价值成长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](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日