

工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发
起式证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
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
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	52

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	52
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	52
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	52
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 市场中性策略执行情况	53
7.13 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
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	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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	57
§ 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	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	工银优选对冲灵活配置混合发起	
基金主代码	010668	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 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	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	71,066,292.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C
下属分级基金的交 易代码	010668	010669
报告期末下属分级 基金的份额总额	44,505,287.82 份	26,561,004.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	合理地灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选数量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货等对冲市场波动风险，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金借助于数量化投研团队在模型计算、组合构建、风险管理的专业能力，优选多种策略，通过合理匹配收益与风险水平构建投资组合。基金管理人依据对市场的展望，灵活选择股票、债券、股指期货等金融工具，力争通过多元化策略避免单一策略的超额收益率波动风险，构造低波动率、低下方风险的投资组合。</p> <p>本基金主要通过考量现阶段股指期货行情来灵活调整股票资产的配置比例。具体而言，基金管理人将计算沪深 300 期货主力合约年化贴水率并以此为基准调整本基金的股票资产比例配置。在股票投资策略方面，本基金基于自建的投研因子数据库和量化投研平台构建股票多头策略，并通过量化择时模型紧密跟踪市场状况和变化，包括风格切换、行业轮动和大类资产配置等。本基金运用的量化投资模型主要包括多因子模型和风险控制模型等。本基金将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。在市场风险对冲策略方面，本基金将根据风险管理的原则，按照相关法律法规的有关规定，进行股指期货投资，主要目的是利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）。
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用对冲策略，与股票市场

	表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95558
传真	010-66583158	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	100033	100020
法定代表人	赵桂才	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C
本期已实现收益	1,338,083.32	929,240.62
本期利润	1,295,918.35	870,277.88
加权平均基金份额本期利润	0.0205	0.0187

本期加权平均净值利润率	2.01%	1.84%
本期基金份额净值增长率	1.46%	1.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-9,720,581.88	-5,900,933.24
期末可供分配基金份额利润	-0.2184	-0.2222
期末基金资产净值	45,788,067.09	27,226,353.21
期末基金份额净值	1.0288	1.0250
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.88%	4.96%

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

工银优选对冲灵活配置混合发起 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	0.87%	0.30%	0.37%	0.01%	0.50%	0.29%
过去三个月	0.09%	0.33%	1.12%	0.01%	-1.03%	0.32%
过去六个月	1.46%	0.36%	2.24%	0.02%	-0.78%	0.34%
过去一年	3.57%	0.29%	4.51%	0.01%	-0.94%	0.28%

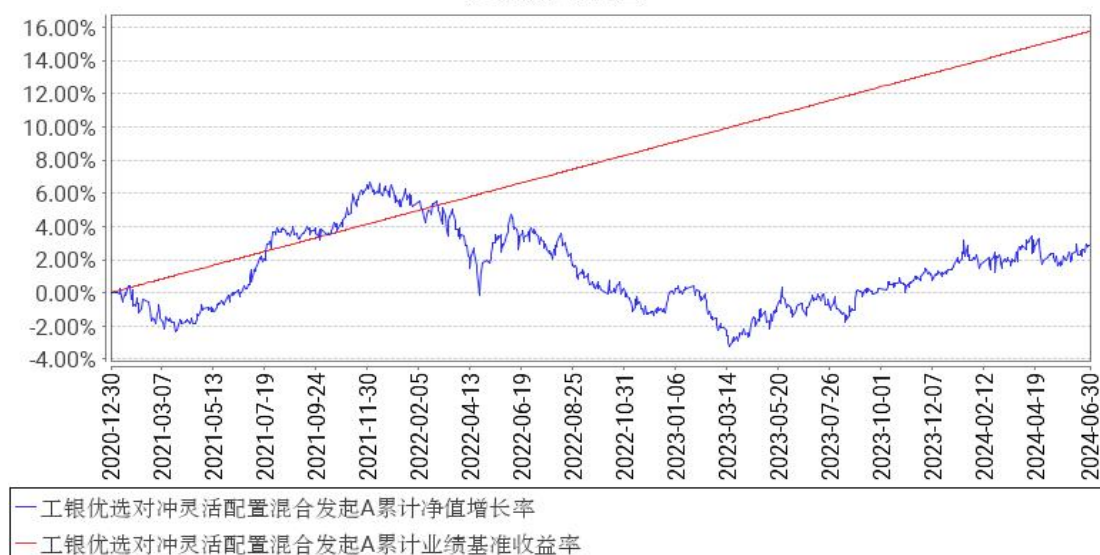
过去三年	1.86%	0.30%	13.51%	0.01%	-11.65%	0.29%
自基金合同生效起至今	2.88%	0.30%	15.76%	0.01%	-12.88%	0.29%

工银优选对冲灵活配置混合发起 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	0.84%	0.30%	0.37%	0.01%	0.47%	0.29%
过去三个月	-0.01%	0.33%	1.12%	0.01%	-1.13%	0.32%
过去六个月	1.25%	0.36%	2.24%	0.02%	-0.99%	0.34%
过去一年	3.22%	0.29%	4.21%	0.01%	-0.99%	0.28%
过去三年	4.13%	0.31%	9.02%	0.01%	-4.89%	0.30%
自基金合同生效起至今	4.96%	0.31%	11.27%	0.01%	-6.31%	0.30%

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

工银优选对冲灵活配置混合发起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



工银优选对冲灵活配置混合发起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 2020 年 12 月 30 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中国工商银行控股的基金管理公司，成立于 2005 年 6 月。目前，公司在北京、上海、深圳等地设有分公司，分别在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

自成立以来，公司坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足专业化、综合化、国际化、数字化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资、绿色投资、责任投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。目前，公司（含子公司）共有员工 787 人，84%的员工拥有硕士以上学历。公司投研团队由资深基金经理和研究员组成，投研人员 215 人，投资人员平均拥

有 12 年的从业经验。

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 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，为超 9000 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 2024 年 6 月 30 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 251 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模约 1.9 万亿元，养老金管理规模居行业领先。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘子豪	本基金的基金经理	2023 年 4 月 12 日	-	4 年	硕士研究生。曾任华兴证券量化研究员；2022 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2023 年 4 月 12 日至今，担任工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理；2023 年 11 月 3 日至今，担任工银瑞信平衡回报 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2024 年 5 月 15 日至今，担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理；2024 年 6 月 4 日至今，担任工银瑞信中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
张乐涛	本基金的基金经理	2022 年 2 月 18 日	2024 年 4 月 2 日	5 年	硕士研究生。2018 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2022 年 2 月 18 日至 2024 年 4 月 2 日，担任工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理；2022 年 2 月 18 日至 2024 年 4 月 2 日，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 2 月 18 日至 2024 年 4 月 2 日，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 2 月 18 日至今，担任工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理；2022 年 2 月 18 日至今，担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资

					基金基金经理；2023 年 8 月 31 日至今，担任工银瑞信中证 1000 增强策略交易型开放式指数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参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 3 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年以来，国内宏观经济处在“经济底部震荡，政策维持呵护”的状态。经济在预期轨道上运行，市场整体呈现震荡格局。风格上，市场呈现“价值优于成长”的局面。一方面，A 股整

体企业盈利周期下行，价值板块的盈利相对优势明显；另一方面，成长板块尤其是新能源、医药等权重方向，在过去几年积累了较为集中的筹码结构且估值不低，叠加地缘政治风险，在今年以来明显偏弱的资金面背景下表现不佳。

股市方面，上半年 A 股整体呈现倒 V 字型走势，红利稳定类行业涨幅靠前。回顾上半年 A 股市场表现，主要宽基指数多数收跌，其中上证综指下跌 0.3%，深证成指下跌 7.1%，沪深 300 指数上涨 0.9%。从风格来看，代表大盘股的中证 100 指数和代表中盘股的中证 500 指数回报分别为 1.4% 和 -9.0%，创业板指和科创 50 回报分别为 -11.0% 和 -16.4%。分行业来看，各行业涨跌幅分化较大，银行、煤炭和公用事业表现排名前三位，收益率分别为 17.0%、12.0% 和 11.8%，计算机、商贸零售和社会服务排名后三位，收益率分别为 -24.9%、-24.6% 和 -24.1%。

年初以来，本基金净值波动受股指期货升贴水和资金申赎影响较大。在仓位选择上，本基金根据股指期货基差变化灵活调整。回顾上半年期货市场，因受到雪球等金融衍生工具波动的影响，IC 和 IM 股指期货合约相对现货的基差出现大幅波动，后期快速收敛，增大了本基金净值的波动。仓位上，上半年资金申赎幅度较大，一定程度上放大了本基金净值波动，随着基差快速收敛，本基金适当提升了仓位。在上半年基金操作中，多头策略 alpha 保持稳定态势，我们采用多个低相关策略叠加，因此在年初量化踩踏行情中，alpha 端基本没有受到影响。本基金在上半年整体风格保持稳定，仍然以量化多因子模型组合为主要配置策略，策略端持续迭代构建新策略，争取获得更为稳定的收益。本基金闲置资金主要用于新股申购以及现金管理，同时参与可转债申购、协议存款、隔夜回购等稳健收益类标的。

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 1.46%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 2.24%；本基金 C 份额净值增长率为 1.25%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为 2.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济内生增长动能依然偏弱，但在政策持续释放积极信号的背景下，我们倾向于认为，更大力度的货币和财政政策能够推动国内经济增长企稳改善。海外方面，虽然当前美国经济和通胀韧性令美联储降息不断后移，我们的基准假设是未来一年美联储降息是大概率事件，这将有助于改善全球金融条件。

我们认为当前影响 A 股市场的核心因素仍是国内经济增长预期。4 月底以来房地产政策态度和落地细则发生了明显调整，给定目前政策力度评估房地产市场和宏观经济的企稳回升仍不足够，但一是政策的态度表明房价出现急速下跌的尾部风险降低；二是从供给侧向需求侧的思路转变，有利于解决当前房地产市场库存堆积、从刚需到改善循环不畅的问题；三是政策突破此前框架为

后续政策出台创造了想象空间，因此我们认为经济增长仍处在下有底、向上弹性的区间，再通胀仍需等待。对应到市场，短期来看，我们认为当前权益市场整体预期较弱，稳定类高股息资产仍可能占优。同时与 GDP 相关的行业配置胜率有所提升但时点仍略偏左侧，可选择产能、资金出清充分的资产进行配置；长期而言，随着科技创新带来的变革，以及 A 股资产估值的收敛，我们认为更大的机会是在不断酝酿的，在未来 3-5 年可以找到更多的投资机会，这里面包括 TMT、医药生物中的一些子板块是我们更为关注的方向。

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（或委员会）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

估值委员会由主任委员、委员组成。

主任委员为公司分管运营副总经理，委员为委员会部门负责人。估值委员会部门包括：投研部门（固定收益部、研究部、指数及量化投资部、FOF 投资部）、风险管理部、法律合规部，运作部。

委员无法出席估值委员会会议的，应指定本部门熟悉情况的人员代为参会，指定人员享有委员同等表决权。

（2）专业胜任能力及相关工作经历

委员会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

投资经理可作为列席人员参会，有发言权，无表决权。

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，并经托管人复核确认。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、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 2024 年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：工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,329,827.93	105,405,065.83
结算备付金		5,686,071.98	96,115,789.45
存出保证金		6,488,122.18	3,936,941.65
交易性金融资产	6.4.7.2	54,607,999.68	33,183,987.35

其中：股票投资		54,607,999.68	33,183,987.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,878,969.59	42,062,312.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		75,990,991.36	280,704,096.61
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,822,794.93	403,814.73
应付管理人报酬		72,656.40	75,849.49
应付托管费		12,109.40	12,641.59
应付销售服务费		9,062.64	4,366.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1,623.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	59,947.69	82,783.74
负债合计		2,976,571.06	581,079.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	71,066,292.34	276,477,112.18
未分配利润	6.4.7.12	1,948,127.96	3,645,905.34
净资产合计		73,014,420.30	280,123,017.52
负债和净资产总计		75,990,991.36	280,704,096.61

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 12 月 30 日。

2、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额为 71,066,292.34 份，其中工银优选对冲灵活配置混合发起 A 基金份额总额为 44,505,287.82 份，基金份额净值 1.0288 元；工银优选对冲灵活配置混合发起 C 基金份额总额为 26,561,004.52 份，基金份额净值 1.0250 元。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,134,098.80	13,457.94
1. 利息收入		286,076.43	15,075.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	286,076.43	10,204.66
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		-	4,871.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,872,048.60	-409,441.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,138,014.46	-502,668.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	10,363,529.67	27,607.29
股利收益	6.4.7.19	646,533.39	65,619.61
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	-101,127.71	407,824.10
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	1,077,101.48	-
减：二、营业总支出		967,902.57	92,389.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	660,528.15	62,020.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	110,088.06	10,336.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	91,918.85	-
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		41,667.71	105.55

8. 其他费用	6.4.7.23	63,699.80	19,925.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,166,196.23	-78,931.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,166,196.23	-78,931.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,166,196.23	-78,931.16

6.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	276,477,112.18	3,645,905.34	280,123,017.52
二、本期期初净资产	276,477,112.18	3,645,905.34	280,123,017.52
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-205,410,819.84	-1,697,777.38	-207,108,597.22
（一）、综合收益总额	-	2,166,196.23	2,166,196.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-205,410,819.84	-3,863,973.61	-209,274,793.45
其中：1. 基金申购款	103,820,098.98	2,138,905.82	105,959,004.80
2. 基金赎回款	-309,230,918.82	-6,002,879.43	-315,233,798.25
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	71,066,292.34	1,948,127.96	73,014,420.30
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	10,596,764.59	7,838.78	10,604,603.37
二、本期期初净资产	10,596,764.59	7,838.78	10,604,603.37
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-43,872.45	-79,057.48	-122,929.93
(一)、综合收益总额	-	-78,931.16	-78,931.16
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-43,872.45	-126.32	-43,998.77
其中：1. 基金申购款	24,677.10	-199.34	24,477.76
2. 基金赎回款	-68,549.55	73.02	-68,476.53
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	10,552,892.14	-71,218.70	10,481,673.44

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

郝焱

关亚君

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

工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2020】2856号文,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2020年12月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为342,010,800.04份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管

理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于

资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2014]81号《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[2015]125号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金在境内卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	2,289,022.56
等于：本金	2,288,694.60
加：应计利息	327.96
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	5,040,805.37
等于：本金	5,040,347.76
加：应计利息	457.61
减：坏账准备	-
合计	7,329,827.93

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,494,315.19	-	54,607,999.68	-3,886,315.51
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	58,494,315.19	-	54,607,999.68	-3,886,315.51

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-57,681,490.00	-	-	
其中：股指期货投资	-57,681,490.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-57,681,490.00	-	-	

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	-37.00	-36,076,480.00	2,101,600.00
IM2409	IM2409	-9.00	-8,604,360.00	1,031,850.00
IM2412	IM2412	-10.00	-9,378,000.00	489,200.00
合计				3,622,650.00
减：可抵销期货暂收款				3,622,650.00
净额				-

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	275.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	19,890.78
预提信息披露费	39,781.56
合计	59,947.69

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银优选对冲灵活配置混合发起 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,971,645.28	146,971,645.28
本期申购	49,308,474.45	49,308,474.45
本期赎回（以“-”号填列）	-151,774,831.91	-151,774,831.91
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	44,505,287.82	44,505,287.82

工银优选对冲灵活配置混合发起 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,505,466.90	129,505,466.90
本期申购	54,511,624.53	54,511,624.53
本期赎回（以“-”号填列）	-157,456,086.91	-157,456,086.91
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	26,561,004.52	26,561,004.52

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

工银优选对冲灵活配置混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-34,595,551.59	36,651,135.27	2,055,583.68
本期期初	-34,595,551.59	36,651,135.27	2,055,583.68

本期利润	1,338,083.32	-42,164.97	1,295,918.35
本期基金份额交易产生的变动数	23,536,886.39	-25,605,609.15	-2,068,722.76
其中：基金申购款	-10,904,888.94	11,983,759.30	1,078,870.36
基金赎回款	34,441,775.33	-37,589,368.45	-3,147,593.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,720,581.88	11,003,361.15	1,282,779.27

工银优选对冲灵活配置混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,703,195.97	32,293,517.63	1,590,321.66
本期期初	-30,703,195.97	32,293,517.63	1,590,321.66
本期利润	929,240.62	-58,962.74	870,277.88
本期基金份额交易产生的变动数	23,873,022.11	-25,668,272.96	-1,795,250.85
其中：基金申购款	-12,199,087.32	13,259,122.78	1,060,035.46
基金赎回款	36,072,109.43	-38,927,395.74	-2,855,286.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,900,933.24	6,566,281.93	665,348.69

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	30,797.64
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	40,145.83
结算备付金利息收入	215,068.16
其他	64.80
合计	286,076.43

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,138,014.46
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	-9,138,014.46

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	297,416,237.35
减：卖出股票成本总额	305,949,376.93
减：交易费用	604,874.88
买卖股票差价收入	-9,138,014.46

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	10,363,529.67

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	646,533.39
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	646,533.39

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,888,937.71
股票投资	-3,888,937.71
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	3,787,810.00
权证投资	-
期货投资	3,787,810.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-101,127.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,075,448.62
基金转换费收入	1,652.86
合计	1,077,101.48

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	3,613.75
存托服务费	13.71
开户费	400.00
合计	63,699.80

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	660,528.15	62,020.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	126,524.97	10.90
应支付基金管理人的净管理费	534,003.18	62,010.03

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,088.06	10,336.83

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C	合计
工银瑞信基金管理有限 公司	-	32,810.25	32,810.25
合计	-	32,810.25	32,810.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C	合计
合计	-	-	-

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 0.40% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金份额销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.47%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C

基金合同生效日（2020 年 12 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.04	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	94.77%	-

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

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

份额单位：份

工银优选对冲灵活配置混合发起 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
工银瑞信 投资管理 有限公司	9,965,716.56	22.39	9,965,716.56	6.78

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中信银行股份有 限公司	2,289,022.56	30,797.64	763,532.63	3,141.96

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（2024 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

无。

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设的风险管理委员会、督察长、公司风险管理与内部控制委员会、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

无。

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,329,827.93	-	-	-	7,329,827.93
结算备付金	5,686,071.98	-	-	-	5,686,071.98
存出保证金	6,488,122.18	-	-	-	6,488,122.18
交易性金融资产	-	-	-	54,607,999.68	54,607,999.68
应收申购款	-	-	-	1,878,969.59	1,878,969.59
资产总计	19,504,022.09	-	-	56,486,969.27	75,990,991.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,822,794.93	2,822,794.93
应付管理人报酬	-	-	-	72,656.40	72,656.40
应付托管费	-	-	-	12,109.40	12,109.40
应付销售服务费	-	-	-	9,062.64	9,062.64
其他负债	-	-	-	59,947.69	59,947.69
负债总计	-	-	-	2,976,571.06	2,976,571.06
利率敏感度缺口	19,504,022.09	-	-	53,510,398.21	73,014,420.30

上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	105,405,065.83	-	-	-	105,405,065.83
结算备付金	96,115,789.45	-	-	-	96,115,789.45
存出保证金	3,936,941.65	-	-	-	3,936,941.65
交易性金融资产	-	-	-	33,183,987.35	33,183,987.35
应收申购款	-	-	-	42,062,312.33	42,062,312.33
资产总计	205,457,796.93	-	-	75,246,299.68	280,704,096.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	403,814.73	403,814.73
应付管理人报酬	-	-	-	75,849.49	75,849.49
应付托管费	-	-	-	12,641.59	12,641.59
应付销售服务费	-	-	-	4,366.30	4,366.30
应交税费	-	-	-	1,623.24	1,623.24
其他负债	-	-	-	82,783.74	82,783.74
负债总计	-	-	-	581,079.09	581,079.09
利率敏感度缺口	205,457,796.93	-	-	74,665,220.59	280,123,017.52

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

市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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	54,607,999.68	74.79	33,183,987.35	11.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	54,607,999.68	74.79	33,183,987.35	11.85

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
分析	业绩比较基准增加 5%	7,319,629.11	23,917,877.07
	业绩比较基准减少 5%	-7,319,629.11	-23,917,877.07

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	54,607,999.68	33,183,987.35
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	54,607,999.68	33,183,987.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于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

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

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，这些金融工具账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	54,607,999.68	71.86
	其中：股票	54,607,999.68	71.86
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	13,015,899.91	17.13
8	其他各项资产	8,367,091.77	11.01
9	合计	75,990,991.36	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	162,195.00	0.22
B	采矿业	2,457,718.00	3.37
C	制造业	33,405,956.88	45.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,452,996.00	3.36
E	建筑业	1,100,659.00	1.51
F	批发和零售业	849,893.20	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	2,312,578.20	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,569,477.46	6.26
J	金融业	4,151,816.20	5.69
K	房地产业	60,084.00	0.08
L	租赁和商务服务业	95,136.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	381,407.74	0.52

N	水利、环境和公共设施管理业	966,742.00	1.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,382,268.00	1.89
S	综合	259,072.00	0.35
	合计	54,607,999.68	74.79

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	688169	石头科技	1,062	416,941.20	0.57
2	000423	东阿阿胶	6,000	375,600.00	0.51
3	601567	三星医疗	10,200	357,000.00	0.49
4	002128	电投能源	16,300	343,930.00	0.47
5	601128	常熟银行	45,410	343,753.70	0.47
6	002078	太阳纸业	24,300	338,985.00	0.46
7	002532	天山铝业	41,600	337,376.00	0.46
8	600642	申能股份	36,400	321,412.00	0.44
9	600873	梅花生物	31,300	313,626.00	0.43
10	689009	九号公司	8,370	308,099.70	0.42
11	300502	新易盛	2,900	306,095.00	0.42
12	002465	海格通信	29,500	305,620.00	0.42
13	600497	驰宏锌锗	56,900	303,846.00	0.42
14	002444	巨星科技	12,300	303,810.00	0.42
15	601717	郑煤机	20,500	303,400.00	0.42
16	600177	雅戈尔	42,500	302,600.00	0.41
17	600529	山东药玻	11,700	296,478.00	0.41
18	603338	浙江鼎力	4,900	296,058.00	0.41
19	000960	锡业股份	19,100	295,859.00	0.41
20	300866	安克创新	4,100	291,961.00	0.40
21	002595	豪迈科技	7,600	290,092.00	0.40
22	300001	特锐德	14,400	289,728.00	0.40
23	601156	东航物流	14,200	288,970.00	0.40
24	000703	恒逸石化	40,700	288,563.00	0.40
25	688188	柏楚电子	1,560	287,898.00	0.39
26	601000	唐山港	61,200	287,640.00	0.39
27	600820	隧道股份	44,000	287,320.00	0.39

28	300724	捷佳伟创	5,300	286,253.00	0.39
29	600699	均胜电子	19,300	286,026.00	0.39
30	601696	中银证券	31,400	285,112.00	0.39
31	002850	科达利	3,700	282,606.00	0.39
32	600141	兴发集团	14,600	278,568.00	0.38
33	600970	中材国际	22,900	276,174.00	0.38
34	600583	海油工程	46,700	275,997.00	0.38
35	688213	思特威	5,654	274,219.00	0.38
36	601966	玲珑轮胎	14,900	273,713.00	0.37
37	601665	齐鲁银行	55,600	272,996.00	0.37
38	000883	湖北能源	45,400	272,854.00	0.37
39	600498	烽火通信	17,100	271,890.00	0.37
40	300677	英科医疗	10,100	270,781.00	0.37
41	000598	兴蓉环境	36,000	270,720.00	0.37
41	300088	长信科技	57,600	270,720.00	0.37
43	000636	风华高科	20,700	270,342.00	0.37
44	002152	广电运通	25,800	269,868.00	0.37
45	300529	健帆生物	9,900	269,379.00	0.37
46	600582	天地科技	38,800	267,332.00	0.37
47	600008	首创环保	99,600	266,928.00	0.37
48	300383	光环新网	31,500	266,175.00	0.36
49	300251	光线传媒	31,200	262,392.00	0.36
50	600535	天士力	20,700	260,406.00	0.36
51	603893	瑞芯微	4,400	260,348.00	0.36
52	601016	节能风电	86,900	259,831.00	0.36
53	600909	华安证券	61,700	259,757.00	0.36
54	603568	伟明环保	12,600	259,308.00	0.36
55	600673	东阳光	36,800	259,072.00	0.35
56	600563	法拉电子	3,400	259,012.00	0.35
57	002056	横店东磁	20,700	258,129.00	0.35
58	002430	杭氧股份	11,600	258,100.00	0.35
59	000729	燕京啤酒	29,200	257,836.00	0.35
60	603156	养元饮品	12,100	257,367.00	0.35
61	002939	长城证券	38,400	257,280.00	0.35
62	600707	彩虹股份	37,700	256,737.00	0.35
63	600737	中粮糖业	26,700	256,053.00	0.35
64	688002	睿创微纳	9,116	254,974.52	0.35
65	000997	新大陆	18,300	254,553.00	0.35
66	000050	深天马A	34,900	254,072.00	0.35
67	300296	利亚德	56,400	253,800.00	0.35
68	002683	广东宏大	12,600	253,638.00	0.35
69	000060	中金岭南	59,800	253,552.00	0.35
70	603298	杭叉集团	12,900	253,356.00	0.35

71	300253	卫宁健康	42,900	253,110.00	0.35
72	002372	伟星新材	16,400	252,888.00	0.35
73	002958	青农商行	94,200	252,456.00	0.35
74	600373	中文传媒	17,000	252,280.00	0.35
75	002500	山西证券	53,500	251,450.00	0.34
76	000887	中鼎股份	20,500	250,920.00	0.34
77	603379	三美股份	6,400	250,496.00	0.34
78	300009	安科生物	29,200	249,368.00	0.34
79	600968	海油发展	60,300	248,436.00	0.34
80	300070	碧水源	58,900	246,791.00	0.34
81	002019	亿帆医药	19,900	245,964.00	0.34
82	600361	创新新材	61,000	245,830.00	0.34
83	600380	健康元	22,000	245,740.00	0.34
84	002065	东华软件	54,200	244,984.00	0.34
85	688521	芯原股份	9,127	244,147.25	0.33
86	000563	陕国投 A	88,700	243,925.00	0.33
87	601598	中国外运	43,300	243,779.00	0.33
88	600528	中铁工业	33,300	243,756.00	0.33
89	002936	郑州银行	140,500	243,065.00	0.33
90	601098	中南传媒	19,500	242,190.00	0.33
91	688538	和辉光电	121,944	241,449.12	0.33
92	600062	华润双鹤	12,300	240,834.00	0.33
93	688234	天岳先进	5,118	240,136.56	0.33
94	600871	石化油服	137,800	239,772.00	0.33
95	600517	国网英大	55,350	239,665.50	0.33
96	000739	普洛药业	17,600	238,832.00	0.33
97	300595	欧普康视	15,200	238,336.00	0.33
98	600959	江苏有线	90,100	237,864.00	0.33
99	002423	中粮资本	31,700	237,433.00	0.33
100	600350	山东高速	26,800	237,180.00	0.32
101	001227	兰州银行	99,400	236,572.00	0.32
102	688220	翱捷科技	6,314	236,522.44	0.32
103	000032	深桑达 A	15,700	235,186.00	0.32
104	600906	财达证券	40,900	234,357.00	0.32
105	002266	浙富控股	83,800	233,802.00	0.32
106	600399	抚顺特钢	41,400	233,082.00	0.32
107	600967	内蒙一机	32,300	232,560.00	0.32
108	600377	宁沪高速	18,400	231,840.00	0.32
109	603444	吉比特	1,300	231,413.00	0.32
110	688425	铁建重工	62,603	230,379.04	0.32
111	002608	江苏国信	29,700	230,175.00	0.32
112	601965	中国汽研	13,600	229,704.00	0.31
113	000958	电投产融	62,700	229,482.00	0.31

114	688567	孚能科技	23,842	228,883.20	0.31
115	688516	奥特维	5,421	226,652.01	0.31
116	000559	万向钱潮	50,800	226,568.00	0.31
117	600500	中化国际	64,600	225,454.00	0.31
118	603786	科博达	3,500	224,525.00	0.31
119	600827	百联股份	30,400	224,352.00	0.31
120	688281	华秦科技	2,659	221,547.88	0.30
121	601228	广州港	72,400	220,820.00	0.30
122	600416	湘电股份	22,100	219,674.00	0.30
123	002563	森马服饰	37,700	219,037.00	0.30
124	688029	南微医学	3,555	218,845.80	0.30
125	603596	伯特利	5,600	217,840.00	0.30
126	601139	深圳燃气	32,400	216,432.00	0.30
127	600299	安迪苏	22,300	216,310.00	0.30
128	603056	德邦股份	16,500	216,150.00	0.30
129	688520	神州细胞	5,402	212,568.70	0.29
130	688006	杭可科技	12,163	212,244.35	0.29
131	688153	唯捷创芯	5,730	212,010.00	0.29
132	600928	西安银行	64,400	210,588.00	0.29
133	688819	天能股份	8,804	210,063.44	0.29
134	002153	石基信息	36,600	209,718.00	0.29
135	688276	百克生物	7,356	208,689.72	0.29
136	601858	中国科传	10,900	208,408.00	0.29
137	600956	新天绿能	25,500	208,335.00	0.29
138	600126	杭钢股份	50,600	207,966.00	0.28
139	601997	贵阳银行	39,100	206,057.00	0.28
140	000039	中集集团	22,200	205,572.00	0.28
141	001203	大中矿业	21,300	204,693.00	0.28
142	301029	怡合达	10,300	202,498.00	0.28
143	688348	昱能科技	3,388	199,892.00	0.27
144	603883	老百姓	9,670	177,541.20	0.24
145	000998	隆平高科	16,500	162,195.00	0.22
146	600129	太极集团	5,600	161,952.00	0.22
147	688301	奕瑞科技	1,398	161,091.54	0.22
148	001872	招商港口	7,800	150,150.00	0.21
149	688789	宏华数科	1,361	146,715.80	0.20
150	002583	海能达	34,700	141,229.00	0.19
151	000600	建投能源	22,300	140,490.00	0.19
152	603328	依顿电子	17,800	139,908.00	0.19
153	688123	聚辰股份	2,271	138,144.93	0.19
154	300679	电连技术	3,400	136,782.00	0.19
155	688100	威胜信息	3,577	136,462.55	0.19
156	300953	震裕科技	2,500	135,500.00	0.19

157	002318	久立特材	5,800	135,314.00	0.19
158	002237	恒邦股份	11,700	134,667.00	0.18
159	600888	新疆众和	19,000	134,330.00	0.18
160	601886	江河集团	27,500	134,200.00	0.18
161	301219	腾远钴业	3,500	133,910.00	0.18
162	600480	凌云股份	13,600	133,688.00	0.18
163	301071	力量钻石	4,800	133,008.00	0.18
164	002274	华昌化工	17,900	132,818.00	0.18
165	300841	康华生物	2,600	131,664.00	0.18
166	605507	国邦医药	7,900	131,535.00	0.18
167	688209	英集芯	10,599	131,533.59	0.18
168	002990	盛视科技	6,500	130,845.00	0.18
169	002053	云南能投	10,800	130,572.00	0.18
170	002249	大洋电机	27,600	130,548.00	0.18
171	601101	昊华能源	14,200	130,498.00	0.18
172	601811	新华文轩	9,300	130,293.00	0.18
173	603103	横店影视	9,400	130,096.00	0.18
174	603733	仙鹤股份	7,400	130,092.00	0.18
175	002011	盾安环境	13,200	129,756.00	0.18
176	603055	台华新材	12,800	129,664.00	0.18
177	688128	中国电研	7,533	129,642.93	0.18
178	600667	太极实业	22,700	129,617.00	0.18
179	002171	楚江新材	19,600	129,164.00	0.18
180	300203	聚光科技	12,800	129,152.00	0.18
181	688776	国光电气	2,330	129,082.00	0.18
182	300783	三只松鼠	5,900	129,033.00	0.18
183	688127	蓝特光学	6,967	128,123.13	0.18
184	000550	江铃汽车	5,900	128,089.00	0.18
185	688152	麒麟信安	3,304	127,930.88	0.18
186	601163	三角轮胎	8,400	127,848.00	0.18
187	002488	金固股份	29,000	127,310.00	0.17
188	300482	万孚生物	5,200	126,880.00	0.17
189	301291	明阳电气	4,200	126,210.00	0.17
190	600810	神马股份	20,300	125,860.00	0.17
191	002123	梦网科技	17,700	124,431.00	0.17
192	688596	正帆科技	3,735	123,255.00	0.17
193	002705	新宝股份	8,760	123,253.20	0.17
194	600933	爱柯迪	8,300	122,757.00	0.17
195	688372	伟测科技	3,120	122,709.60	0.17
196	601001	晋控煤业	7,400	122,248.00	0.17
197	300451	创业慧康	35,300	122,138.00	0.17
198	002068	黑猫股份	17,200	122,120.00	0.17
199	600966	博汇纸业	25,500	121,890.00	0.17

200	603699	纽威股份	7,100	121,552.00	0.17
201	603989	艾华集团	8,600	120,916.00	0.17
202	002276	万马股份	16,700	119,739.00	0.16
203	603456	九洲药业	8,600	117,992.00	0.16
204	688408	中信博	1,279	117,770.32	0.16
205	688048	长光华芯	3,750	117,150.00	0.16
206	002534	西子洁能	11,600	116,116.00	0.16
207	603368	柳药集团	6,600	115,500.00	0.16
208	688167	炬光科技	2,084	114,620.00	0.16
209	600409	三友化工	22,800	114,456.00	0.16
210	002978	安宁股份	4,100	114,226.00	0.16
211	002283	天润工业	26,200	112,398.00	0.15
212	688106	金宏气体	6,402	112,163.04	0.15
213	002782	可立克	10,100	111,908.00	0.15
214	601311	骆驼股份	13,800	110,676.00	0.15
215	603323	苏农银行	22,800	109,668.00	0.15
216	600320	振华重工	31,900	109,098.00	0.15
217	688185	康希诺	2,633	108,189.97	0.15
218	688343	云天励飞	3,765	107,490.75	0.15
219	600575	淮河能源	27,000	105,030.00	0.14
220	600012	皖通高速	7,500	104,775.00	0.14
221	600420	国药现代	9,700	103,596.00	0.14
222	002991	甘源食品	1,700	103,105.00	0.14
223	002020	京新药业	9,800	102,606.00	0.14
224	603162	海通发展	11,000	102,300.00	0.14
225	600285	羚锐制药	4,200	101,682.00	0.14
226	000065	北方国际	9,700	100,589.00	0.14
227	600557	康缘药业	6,400	100,480.00	0.14
228	600446	金证股份	10,100	100,293.00	0.14
229	000035	中国天楹	22,000	99,660.00	0.14
230	603113	金能科技	18,100	99,007.00	0.14
231	600586	金晶科技	16,800	97,440.00	0.13
232	300027	华谊兄弟	58,400	96,944.00	0.13
233	300702	天宇股份	5,300	94,499.00	0.13
234	688023	安恒信息	2,316	92,663.16	0.13
235	603871	嘉友国际	5,180	91,634.20	0.13
236	301316	慧博云通	6,200	91,016.00	0.12
237	603439	贵州三力	7,000	89,320.00	0.12
238	600475	华光环能	10,200	88,842.00	0.12
239	002028	思源电气	1,300	86,970.00	0.12
240	002649	博彦科技	10,900	86,764.00	0.12
241	603556	海兴电力	1,800	84,294.00	0.12
242	603881	数据港	6,100	77,531.00	0.11

243	002291	遥望科技	17,900	76,970.00	0.11
244	301498	乖宝宠物	1,400	75,320.00	0.10
245	301327	华宝新能	1,300	74,490.00	0.10
246	600391	航发科技	4,700	71,675.00	0.10
247	600301	华锡有色	3,500	70,770.00	0.10
248	688031	星环科技	1,901	69,785.71	0.10
249	002126	银轮股份	3,900	67,899.00	0.09
250	300226	上海钢联	3,900	66,066.00	0.09
251	002913	奥士康	2,400	64,344.00	0.09
252	603985	恒润股份	5,400	64,260.00	0.09
253	601528	瑞丰银行	13,600	64,192.00	0.09
254	000727	冠捷科技	30,900	63,654.00	0.09
255	002315	焦点科技	2,300	62,008.00	0.08
256	603936	博敏电子	7,200	60,480.00	0.08
257	688639	华恒生物	771	58,896.69	0.08
258	300113	顺网科技	5,700	58,368.00	0.08
259	000915	华特达因	1,900	57,304.00	0.08
260	688389	普门科技	3,519	57,218.94	0.08
261	002250	联化科技	11,400	54,720.00	0.07
262	601577	长沙银行	6,000	49,080.00	0.07
263	002948	青岛银行	14,400	48,528.00	0.07
264	300065	海兰信	7,100	46,931.00	0.06
265	688208	道通科技	1,941	46,855.74	0.06
266	300527	中船应急	7,200	46,584.00	0.06
267	002204	大连重工	10,900	46,543.00	0.06
268	300327	中颖电子	2,300	45,264.00	0.06
269	688018	乐鑫科技	445	43,912.60	0.06
270	600549	厦门钨业	2,500	43,125.00	0.06
271	688383	新益昌	807	42,052.77	0.06
272	601058	赛轮轮胎	3,000	42,000.00	0.06
273	688351	微电生理	1,904	41,964.16	0.06
274	600246	万通发展	6,000	40,320.00	0.06
275	002697	红旗连锁	8,700	40,281.00	0.06
276	688798	艾为电子	705	39,917.10	0.05
277	002135	东南网架	10,000	39,600.00	0.05
278	002174	游族网络	5,000	37,950.00	0.05
279	003039	顺控发展	2,900	36,337.00	0.05
280	002646	天佑德酒	3,500	35,805.00	0.05
281	300077	国民技术	4,100	35,793.00	0.05
282	300123	亚光科技	7,700	35,728.00	0.05
283	002139	拓邦股份	3,300	35,046.00	0.05
284	300366	创意信息	4,800	34,752.00	0.05
285	002745	木林森	4,300	34,658.00	0.05

286	601126	四方股份	1,800	34,596.00	0.05
287	600458	时代新材	3,400	34,340.00	0.05
288	688239	航宇科技	986	34,312.80	0.05
289	002807	江阴银行	9,100	34,307.00	0.05
290	300638	广和通	2,000	34,200.00	0.05
290	300857	协创数据	600	34,200.00	0.05
290	603299	苏盐井神	3,600	34,200.00	0.05
293	002354	天娱数科	11,400	34,086.00	0.05
294	002467	二六三	10,200	34,068.00	0.05
295	300035	中科电气	4,000	34,040.00	0.05
296	300303	聚飞光电	7,000	34,020.00	0.05
297	688158	优刻得	3,319	33,953.37	0.05
298	600366	宁波韵升	6,500	33,930.00	0.05
299	600797	浙大网新	7,300	33,799.00	0.05
300	605222	起帆电缆	2,200	33,748.00	0.05
301	300747	锐科激光	1,900	33,725.00	0.05
302	002212	天融信	6,900	33,603.00	0.05
303	000758	中色股份	6,600	33,528.00	0.05
304	603118	共进股份	5,000	33,500.00	0.05
305	002993	奥海科技	900	33,480.00	0.05
306	605333	沪光股份	1,200	33,420.00	0.05
307	300134	大富科技	4,900	33,418.00	0.05
307	300348	长亮科技	4,900	33,418.00	0.05
309	300080	易成新能	11,600	33,408.00	0.05
309	300232	洲明科技	6,400	33,408.00	0.05
309	300352	北信源	8,700	33,408.00	0.05
309	300687	赛意信息	2,400	33,408.00	0.05
313	688001	华兴源创	1,477	33,350.66	0.05
314	002585	双星新材	6,700	33,232.00	0.05
315	688400	凌云光	1,990	33,193.20	0.05
316	300085	银之杰	4,100	33,128.00	0.05
316	300587	天铁股份	8,200	33,128.00	0.05
318	002484	江海股份	2,500	33,125.00	0.05
319	603212	赛伍技术	3,000	33,120.00	0.05
320	002036	联创电子	4,900	33,075.00	0.05
321	600158	中体产业	4,300	33,067.00	0.05
322	300323	华灿光电	7,600	33,060.00	0.05
323	300166	东方国信	5,400	33,048.00	0.05
324	688066	航天宏图	1,856	33,036.80	0.05
325	002396	星网锐捷	2,500	33,025.00	0.05
326	002777	久远银海	2,200	32,978.00	0.05
327	002221	东华能源	4,000	32,840.00	0.04
328	688007	光峰科技	2,039	32,827.90	0.04

329	688190	云路股份	439	32,797.69	0.04
330	002099	海翔药业	6,400	32,704.00	0.04
330	300369	绿盟科技	6,400	32,704.00	0.04
332	300382	斯莱克	5,500	32,505.00	0.04
333	688033	天宜上佳	5,415	32,490.00	0.04
334	688388	嘉元科技	3,332	32,487.00	0.04
335	688680	海优新材	1,130	32,476.20	0.04
336	000968	蓝焰控股	5,100	32,436.00	0.04
337	603489	八方股份	1,200	32,376.00	0.04
338	601969	海南矿业	5,100	32,334.00	0.04
339	300379	东方通	4,000	32,320.00	0.04
340	601975	招商南油	9,000	32,310.00	0.04
341	002549	凯美特气	6,300	32,193.00	0.04
342	002453	华软科技	7,500	32,175.00	0.04
343	688800	瑞可达	1,142	32,067.36	0.04
344	000811	冰轮环境	3,300	31,845.00	0.04
345	603039	泛微网络	1,000	31,760.00	0.04
346	600449	宁夏建材	2,700	31,725.00	0.04
347	000969	安泰科技	4,000	31,720.00	0.04
348	605009	豪悦护理	800	31,552.00	0.04
349	300820	英杰电气	800	31,472.00	0.04
350	688298	东方生物	1,159	31,466.85	0.04
351	301205	联特科技	500	31,375.00	0.04
352	002100	天康生物	4,500	31,185.00	0.04
353	688598	金博股份	1,092	30,903.60	0.04
354	688270	臻镭科技	1,184	30,902.40	0.04
355	688262	国芯科技	1,694	30,847.74	0.04
356	600403	大有能源	11,900	30,702.00	0.04
357	000016	深康佳 A	14,400	30,672.00	0.04
358	601015	陕西黑猫	10,900	30,520.00	0.04
359	688321	微芯生物	1,732	30,483.20	0.04
360	600595	中孚实业	12,200	30,378.00	0.04
361	688608	恒玄科技	207	30,300.66	0.04
362	603297	永新光学	500	30,245.00	0.04
363	002043	兔宝宝	2,900	30,073.00	0.04
364	300770	新媒股份	900	30,042.00	0.04
365	300674	宇信科技	2,700	29,916.00	0.04
366	688177	百奥泰	1,410	29,779.20	0.04
367	000034	神州数码	1,300	29,757.00	0.04
368	688268	华特气体	573	29,572.53	0.04
369	002191	劲嘉股份	8,100	29,241.00	0.04
370	688192	迪哲医药	792	29,177.28	0.04
371	603063	禾望电气	1,900	29,127.00	0.04

372	000415	渤海租赁	11,400	29,070.00	0.04
373	688046	药康生物	2,837	28,994.14	0.04
374	000813	德展健康	13,900	28,912.00	0.04
375	601908	京运通	11,400	28,842.00	0.04
376	600066	宇通客车	1,100	28,380.00	0.04
377	688630	芯碁微装	450	28,156.50	0.04
378	688515	裕太微	485	28,130.00	0.04
379	600169	太原重工	15,300	27,999.00	0.04
380	601011	宝泰隆	17,300	27,680.00	0.04
381	600961	株冶集团	2,900	27,376.00	0.04
382	002402	和而泰	2,500	26,775.00	0.04
383	002158	汉钟精机	1,600	26,752.00	0.04
384	688503	聚和材料	951	26,723.10	0.04
385	688019	安集科技	212	26,669.60	0.04
386	000627	天茂集团	15,200	26,600.00	0.04
387	600757	长江传媒	3,300	26,598.00	0.04
388	688686	奥普特	409	26,188.27	0.04
389	600691	阳煤化工	15,300	26,163.00	0.04
390	002839	张家港行	6,500	26,130.00	0.04
391	603666	亿嘉和	1,600	25,248.00	0.03
392	600248	陕建股份	6,900	25,047.00	0.03
393	000933	神火股份	1,200	24,276.00	0.03
394	603317	天味食品	2,100	23,961.00	0.03
395	688711	宏微科技	1,448	23,254.88	0.03
396	688235	百济神州	200	23,168.00	0.03
397	002681	奋达科技	6,300	22,995.00	0.03
398	600610	中毅达	5,200	20,696.00	0.03
399	000923	河钢资源	1,200	20,664.00	0.03
400	601702	华峰铝业	1,100	20,086.00	0.03
401	600007	中国国贸	900	19,764.00	0.03
402	688016	心脉医疗	200	19,610.00	0.03
403	300394	天孚通信	220	19,452.40	0.03
404	002340	格林美	3,000	19,110.00	0.03
405	002961	瑞达期货	1,400	15,330.00	0.02
406	600885	宏发股份	500	13,840.00	0.02
407	603100	川仪股份	500	11,755.00	0.02
408	603906	龙蟠科技	1,400	10,906.00	0.01
409	300406	九强生物	600	9,228.00	0.01
410	300037	新宙邦	300	8,568.00	0.01
411	688707	振华新材	748	7,285.52	0.01
412	603306	华懋科技	400	7,228.00	0.01
413	600170	上海建工	3,100	6,665.00	0.01
414	600502	安徽建工	1,500	6,450.00	0.01

415	301175	中科环保	1,400	6,146.00	0.01
416	600812	华北制药	1,300	5,356.00	0.01
417	601077	渝农商行	700	3,514.00	0.00
418	300579	数字认证	100	1,950.00	0.00
419	002063	远光软件	180	943.20	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	600519	贵州茅台	2,253,740.00	0.80
2	688127	蓝特光学	1,110,661.05	0.40
3	300001	特锐德	1,102,704.00	0.39
4	601058	赛轮轮胎	1,071,013.00	0.38
5	000923	河钢资源	1,070,210.00	0.38
6	600869	远东股份	1,051,799.00	0.38
7	000543	皖能电力	1,025,657.00	0.37
8	002422	科伦药业	1,015,255.00	0.36
9	688596	正帆科技	986,507.32	0.35
10	300687	赛意信息	986,381.00	0.35
11	600458	时代新材	985,446.00	0.35
12	301239	普瑞眼科	976,886.00	0.35
13	688169	石头科技	958,275.27	0.34
14	601318	中国平安	947,193.00	0.34
15	688088	虹软科技	943,698.20	0.34
16	300953	震裕科技	932,309.00	0.33
17	603368	柳药集团	928,076.71	0.33
18	301301	川宁生物	913,189.00	0.33
19	000035	中国天楹	909,962.00	0.32
20	688268	华特气体	908,783.61	0.32

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	600519	贵州茅台	2,363,780.00	0.84
2	000543	皖能电力	1,281,085.00	0.46
3	000923	河钢资源	1,233,079.00	0.44
4	600458	时代新材	1,142,718.00	0.41

5	601137	博威合金	1,113,851.00	0.40
6	688127	蓝特光学	1,075,355.92	0.38
7	002422	科伦药业	1,061,830.00	0.38
8	000415	渤海租赁	1,040,724.00	0.37
9	601318	中国平安	1,025,034.00	0.37
10	301239	普瑞眼科	1,016,676.00	0.36
11	600869	远东股份	1,005,309.00	0.36
12	002130	沃尔核材	979,729.00	0.35
13	603063	禾望电气	950,825.60	0.34
14	688018	乐鑫科技	949,368.75	0.34
15	301301	川宁生物	929,529.24	0.33
16	601058	赛轮轮胎	923,504.00	0.33
17	688190	云路股份	922,815.97	0.33
18	688088	虹软科技	914,117.45	0.33
19	600531	豫光金铅	906,259.32	0.32
20	603160	汇顶科技	904,189.00	0.32

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	331,262,326.97
卖出股票收入（成交）总额	297,416,237.35

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 54,607,999.68 元，占基金资产净值的比例为 74.79%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 54,058,840.00 元，占基金资产净值的比例为 74.04%，空头合约市值占股票资产的比例为 98.99%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 1,225,515.21 元，公允价值变动损益为-101,127.71 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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中，江苏常熟农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方银保监局的处罚。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

7.13.2 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。

7.13.3 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	6,488,122.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,878,969.59
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,367,091.77

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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 (%)
工银优选 对冲灵活 配置混合 发起 A	529	84,130.98	20,493,931.60	46.05	24,011,356.22	53.95
工银优选 对冲灵活 配置混合 发起 C	277	95,888.10	18,733,617.99	70.53	7,827,386.53	29.47
合计	806	88,171.58	39,227,549.59	55.20	31,838,742.75	44.80

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	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	50,794.81	0.11
	工银优选对冲灵活配置混合发起 C	-	-
	合计	50,794.81	0.07

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	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	0~10
	工银优选对冲灵活配置混合发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	0
	工银优选对冲灵活配置混合发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银优选对冲灵活配置混合发起 A	工银优选对冲灵活配置混合发起 C
基金合同生效日 （2020 年 12 月 30 日）基金份额总额	302,002,400.04	40,008,400.00
本报告期期初基金份额总额	146,971,645.28	129,505,466.90
本报告期基金总申购份额	49,308,474.45	54,511,624.53
减：本报告期基金总赎回份额	151,774,831.91	157,456,086.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	44,505,287.82	26,561,004.52

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
财信证券	2	628,678,564.32	100.00	415,812.30	100.00	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准

- 财务状况良好。
- 经营行为规范。
- 合规记录优良。
- 研究服务能力良好，具有较为完备的研究人员队伍和研究体系。

(2) 选择程序

根据以上标准,基金管理人将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。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 在合同存续期间,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公司租用其交易单元。

(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(%)
财信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024年1月23日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京中期时代销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024年2月29日
3	关于工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会规定的媒介	2024年4月3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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240103-20240129	54,337,575.60	-	54,337,575.60	-	-
	2	20240605-20240630	14,819,205.69	-	-	14,819,205.69	20.85
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中，存在基金规模大幅波动的风险，以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

注：1、期初份额为上期期末或基金合同公告生效日当天份额。

2、期间申购份额：含买入、红利再投、转换入份额；期间赎回份额：含卖出、转换出份额。

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优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式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

2024年8月30日