工银瑞信聚享混合型证券投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 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、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 11

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17

§6 审计报告 17

6.1 审计报告基本信息 17
6.2 审计报告的基本内容 17

§7 年度财务报表 19

7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 21
7.4 报表附注 23

§8 投资组合报告 50

8.1 期末基金资产组合情况 50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 63
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 63
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 63
8.14 投资组合报告附注 63

§9 基金份额持有人信息 64

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 64

§10 开放式基金份额变动 65

§11 重大事件揭示 65

11.1 基金份额持有人大会决议 65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
11.4 基金投资策略的改变 66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 67
11.8 其他重大事件 68

§12 影响投资者决策的其他重要信息 69

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 69

§13 备查文件目录 69

13.1 备查文件目录 69
13.2 存放地点 70
13.3 查阅方式 70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信聚享混合型证券投资基金	
基金简称	工银聚享混合	
基金主代码	011729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 24 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	53,477,199.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C
下属分级基金的交易代码	011729	011730
报告期末下属分级基金的份额总额	46,041,529.89 份	7,435,669.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，执行“自上而下”的资产配置及动态调整策略。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，增加非权益类资产配置比例，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。 本基金在债券投资与研究方面,实行投资策略研究专业化分工制度，专业研究人员分别从利率、债券信用风险等角度，提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成指导性投资策略。本基金买入信用债的债项评级不得低于 AA，其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级执行。本基金投资 AAA 的信用债券占信用债券资产的比例不低于 50%、投资 AA+的信用债券占信用债券资产的比例不高于 50%、投资 AA 的信用债券占信用债券资产的比例不高于 20%。 本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经

	营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。
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。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	周直毅
	联系电话	400-811-9999	021-68475608
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-811-9999	95594
传真		010-66583158	021-68476901
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	上海市黄浦区中山南路 688 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		100033	200120
法定代表人		赵桂才	金煜

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人或基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C

本期已实现收益	3,927,298.89	467,777.33	-7,069,831.94	24,665.66	-9,319,133.65	-751,296.71
本期利润	2,716,124.87	626,062.05	-4,456,441.87	69,755.02	-13,759,584.64	-3,914,435.48
加权平均基金份额本期利润	0.0562	0.1200	-0.0676	0.0644	-0.0646	-0.1780
本期加权平均净值利润率	6.37%	13.53%	-7.24%	7.21%	-6.38%	-17.64%
本期基金份额净值增长率	8.37%	7.92%	-7.64%	-8.01%	-4.57%	-3.91%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-1,479,529.31	-265,622.66	-6,709,365.59	-436,266.78	-2,407,738.61	-2,885.66
期末可供分配基金份额利润	-0.0321	-0.0357	-0.1221	-0.1218	-0.0205	-0.0162
期末基金资产净值	45,247,841.30	7,281,274.76	49,840,406.46	3,249,153.46	115,194,277.35	175,713.98
期末基金	0.9828	0.9792	0.9069	0.9073	0.9819	0.9863

份额净值						
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.72%	-2.08%	-9.31%	-9.27%	-1.81%	-1.37%

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

工银聚享混合 A

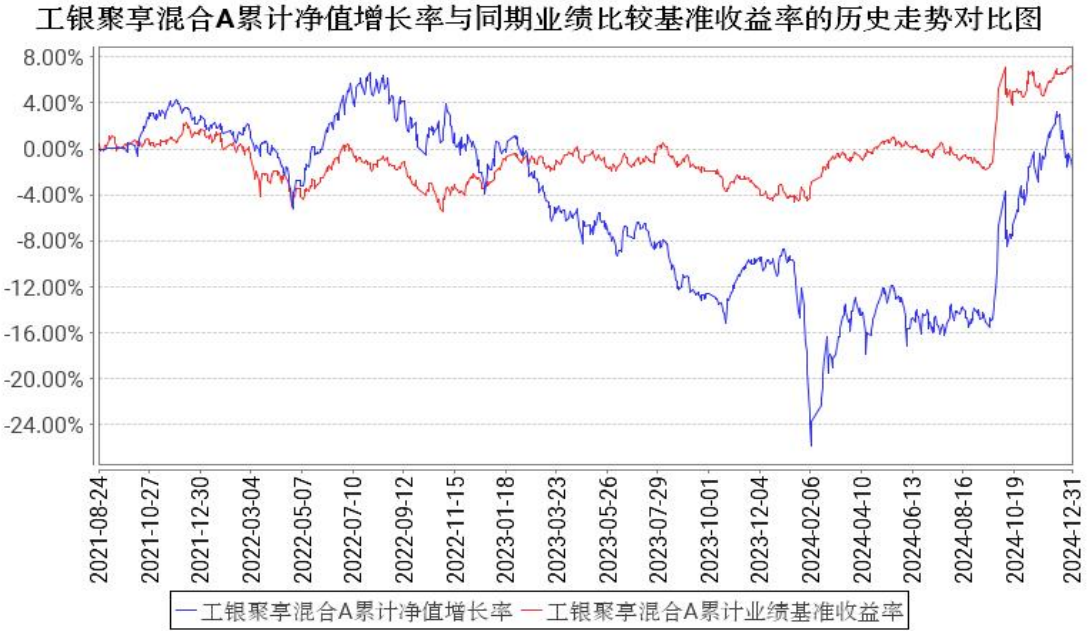
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.41%	1.07%	1.51%	0.52%	3.90%	0.55%
过去六个月	14.89%	0.96%	7.00%	0.48%	7.89%	0.48%
过去一年	8.37%	1.06%	10.21%	0.39%	-1.84%	0.67%
过去三年	-4.48%	0.75%	5.07%	0.35%	-9.55%	0.40%
自基金合同生效起至今	-1.72%	0.72%	6.81%	0.34%	-8.53%	0.38%

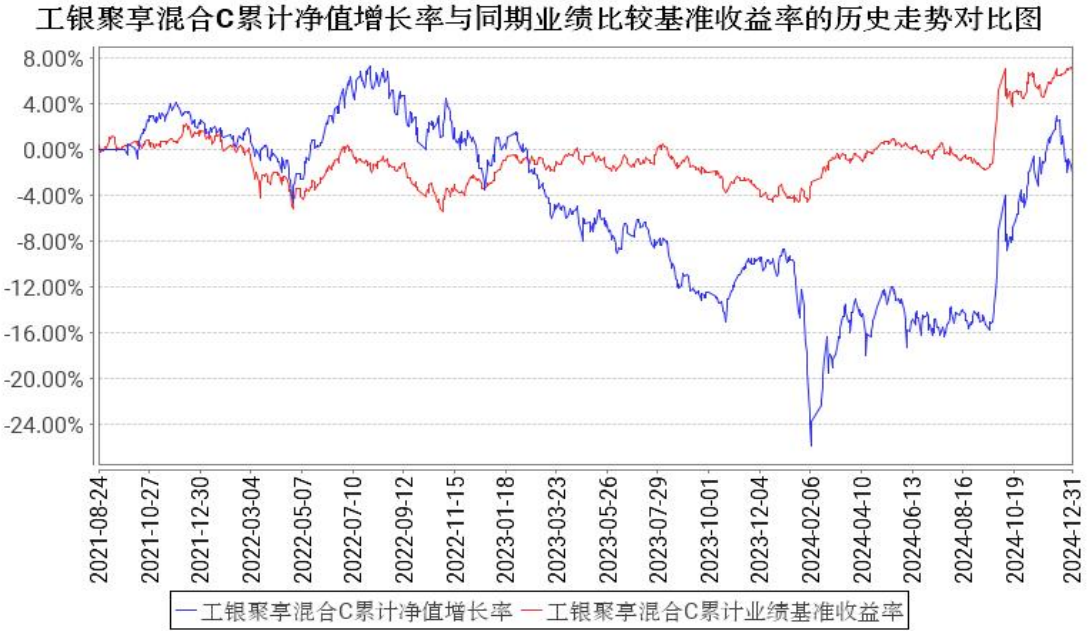
工银聚享混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①－③	②－④

		②	率③	准差④		
过去三个月	5.29%	1.07%	1.51%	0.52%	3.78%	0.55%
过去六个月	14.66%	0.96%	7.00%	0.48%	7.66%	0.48%
过去一年	7.92%	1.06%	10.21%	0.39%	-2.29%	0.67%
过去三年	-4.60%	0.76%	5.07%	0.35%	-9.67%	0.41%
自基金合同生效起至今	-2.08%	0.72%	6.81%	0.34%	-8.89%	0.38%

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

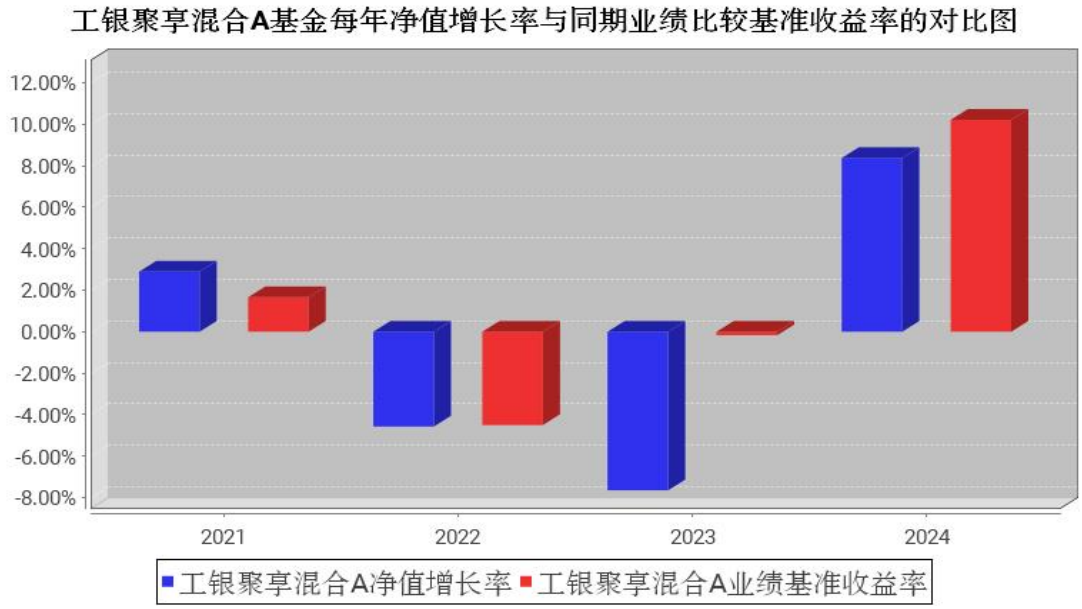


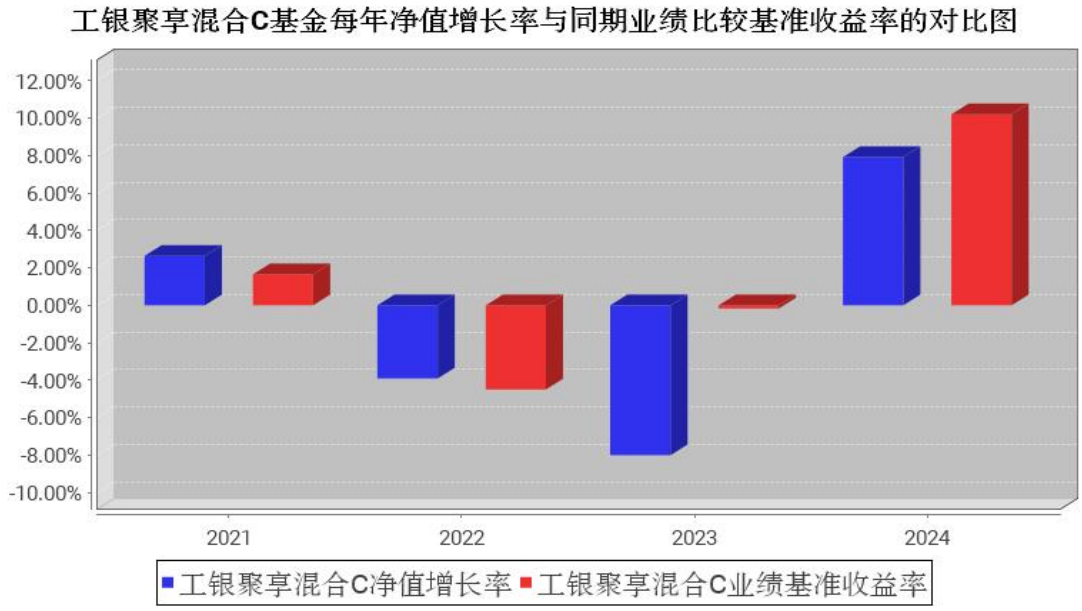


注：1、本基金基金合同于 2021 年 08 月 24 日生效。

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

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





3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是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 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 12 月 31 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 254 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 2 万亿元，养老金管理规模居行业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
焦文龙	指数及量化投资部总经理、	2023 年 9 月 22 日	-	15 年	硕士研究生。曾任鹏华基金执行总经理，基金经理；2021 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部总经理、基金经理。2022 年 11 月 25 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活

	本基金的基金经理				配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 25 日至今，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；2023 年 9 月 22 日至今，担任工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金经理；2024 年 11 月 8 日至今，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金（LOF）基金经理；2024 年 11 月 19 日至今，担任工银瑞信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2024 年 11 月 26 日至今，担任工银瑞信中证 A500 指数证券投资基金（自 2024 年 12 月 10 日起，变更为工银瑞信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理。
何顺	本基金的基金经理	2023 年 10 月 20 日	-	4 年	博士研究生。2020 年加入工银瑞信，曾任指数及量化投资部量化研究员，现任指数及量化投资部基金经理。2023 年 10 月 20 日至今，担任工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金经理；2024 年 4 月 1 日至今，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；2024 年 5 月 15 日至今，担任工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理；2024 年 5 月 30 日至今，担任工银瑞信中证港股通高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2024 年 11 月 7 日至今，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金（LOF）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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部

规章，制定了《公平交易管理办法》，对公司管理的各类投资组合的公平对待做了明确具体的规定，办法涵盖了公平交易的原则、适用范围、部门职责、具体程序和违规问责等。

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

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 11 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 年欧美经济增长和通货膨胀均呈现回落态势，货币政策进入宽松周期。欧美连续降息后，四季度全球经济环比温和修复，主要经济体中除欧元区外总体出现改善态势。

2024 年国内经济增长呈现“U 型”走势。一季度 GDP 增速较高，二、三季度有所放缓，而后随着一揽子稳增长政策的接续发力，四季度增长动能逐步增强。分结构看，2024 年出口对经济增长发挥重要支撑作用。内需方面，“以旧换新”等政策红利带动耐用消费品零售明显增长，新兴产业发展带动制造业投资维持高位。

2024 年 A 股市场波动较大。受益于 9 月底政策积极信号强化，全年上证综指、沪深 300、中证 500、创业板指等均实现年度正收益。从市场风格看，全年 A 股市场风格整体偏向价值板块，银行、非银金融、家电等行业涨幅居前。与此同时，人工智能、机器人等新兴产业的投资机会也较为丰富。

国内利率全年整体处于下行趋势，四季度出现加速下行的迹象，期限利差持续处于较低的水平。权益资产的估值水平整体处于低位，虽然下半年有所修复，但仍然处于合理偏低的水平，风险溢价水平 ERP 持续处于高位。从相对估值水平来看，权益资产相对债券资产性价比更高，组合持续保持相对基准适当超配权益资产，相对基准适当低配债券资产。债券方面，国内利率水平整体处于低位，在政策面持续发力的背景下，经济有望进入复苏，利率存在一定上行风险，且期限利差处于低位，因此组合债券方面以短久期、高评级的债券为主。权益方面以定量化筛选、分散配置策略为主。

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 8.37%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 10.21%；本基金 C 份额净值增长率为 7.92%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为 10.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外经济方面，预计 2025 年海外经济增长动能或将进一步趋弱但韧性仍存。美国通胀存在上行风险，美联储降息进度或将会出现延后。

国内经济方面，国内财政政策可能将更加积极，货币政策将适度宽松。我们认为，随着国内政策的陆续加力，2025 年国内经济增长将逐步企稳改善。考虑到外需不确定性加大，内需或将是国内稳增长的重要抓手和结构性亮点的主要来源。与此同时，在政策大力推动新质生产力发展的背景下，科技创新领域也是重要看点。

预计政策因素将是影响 2025 年资本市场的关键变量。海外来看，美国加征对华关税及对国内

高科技领域的限制等政策，是加大市场波动的潜在因素。尽管如此，考虑到国内政策有望积极，国内债券收益率已明显下行，我们对全年权益市场不悲观，确定性较强的产业趋势和优质公司将是权益市场收益的主要来源。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强监察稽核工作，及时识别和管控法律合规风险，保障公司合法合规开展业务。

1、严格事前审查控制。积极跟踪法律法规变化和监管动态，及时解读并向业务部门传达最新法规和监管要求，分析对公司业务的影响，落实管理责任部门。结合法律法规和行业新要求，督促制定、更新规章制度和完善业务流程。落实事前审核机制，事前审核产品设计、基金募集、产品运营、持续营销与宣传推介、信息披露等关键环节，通过系统实现对组合投资合规风险的事前控制。

2、持续开展事中监控与事后管理。设置专人专岗监控投资指标，通过系统和人工结合的方式，实现对重点环节的监控和刚性控制，系统无法实现控制的环节强化人工审核复核。通过系统事后监测及时提示组合被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围。持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段监督投资管理人员行为，建立公平交易异常交易监控模型分析投资行为，防范发生违反行业“三条底线”的情形。持续关注内部控制的健全性有效性，定期梳理业务流程，对风险进行识别与评估，对控制措施提出改进建议。

3、重视合规培训，提升全员合规意识。公司通过新员工合规培训、定期全员合规培训、投研人员和销售人员专项培训等多种形式，深入解读培训新法新规，深刻剖析行业风险事件，使监管政策、公司制度得到有效落实，不断增强员工合规意识，促进合规文化建设，牢实合规管理基础。

4、开展专项稽核检查。定期对基金投研交易、销售和产品运营等核心业务和关键环节开展稽核检查，对法规落实情况、规章制度执行情况、合规和风险管控情况进行监督评价，并跟进整改情况。同时，根据年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或委员会）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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内（2024 年 1 月 30 日至 2024 年 4 月 17 日、2024 年 4 月 25 日至 2024 年 7 月 8 日、2024 年 7 月 12 日至 2024 年 9 月 18 日、2024 年 10 月 29 日至 2024 年 12 月 4 日）出现连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70026366_A144 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信聚享混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了工银瑞信聚享混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的工银瑞信聚享混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信聚享混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于工银瑞信聚享混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	工银瑞信聚享混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	在编制财务报表时，管理层负责评估工银瑞信聚享混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督工银瑞信聚享混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对工银瑞信聚享混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银瑞信聚享混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	贺耀　　张晓阳
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2025 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信聚享混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,341,071.97	870,772.73
结算备付金		779,208.89	43,513.99
存出保证金		33,844.87	20,669.77
交易性金融资产	7.4.7.2	46,083,249.82	51,457,691.48
其中：股票投资		20,213,758.13	21,192,456.80
基金投资		-	-
债券投资		25,869,491.69	30,265,234.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-326.71	-102.67
应收清算款		4,500,653.43	918,730.97
应收股利		-	-
应收申购款		61,466.83	5,423.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		52,799,169.10	53,316,699.29
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		190,360.24	10,296.03
应付管理人报酬		22,324.95	22,363.03
应付托管费		4,465.00	4,472.64
应付销售服务费		2,461.32	1,081.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,843.10	2,119.31

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	48,598.43	186,807.24
负债合计		270,053.04	227,139.37
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	53,477,199.21	58,539,334.42
未分配利润	7.4.7.12	-948,083.15	-5,449,774.50
净资产合计		52,529,116.06	53,089,559.92
负债和净资产总计		52,799,169.10	53,316,699.29

注： 1、本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 24 日。

2、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额为 53,477,199.21 份，其中工银聚享混合 A 基金份额总额为 46,041,529.89 份，基金份额净值 0.9828 元；工银聚享混合 C 基金份额总额为 7,435,669.32 份，基金份额净值 0.9792 元。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信聚享混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		3,685,739.98	-3,821,486.35
1.利息收入		101,193.44	245,643.08
其中：存款利息收入	7.4.7.13	18,792.93	56,429.30
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		82,400.51	189,213.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,511,281.07	-6,785,511.08
其中：股票投资收益	7.4.7.14	3,822,961.51	-7,822,925.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	520,678.02	971,054.85
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	167,641.54	66,359.12
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-1,052,889.30	2,658,479.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	126,154.77	59,902.22
减：二、营业总支出		343,553.06	565,200.50
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	236,043.66	317,065.09
2．托管费	7.4.10.2.2	47,208.75	63,413.13
3．销售服务费	7.4.10.2.3	18,358.03	3,848.22
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		2,762.24	809.55
8．其他费用	7.4.7.23	39,180.38	180,064.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,342,186.92	-4,386,686.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,342,186.92	-4,386,686.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,342,186.92	-4,386,686.85

7.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信聚享混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	58,539,334.42	-5,449,774.50	53,089,559.92
二、本期期初净资产	58,539,334.42	-5,449,774.50	53,089,559.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,062,135.21	4,501,691.35	-560,443.86
（一）、综合收益总额	-	3,342,186.92	3,342,186.92
（二）、本期基金份额交易产生的净资	-5,062,135.21	1,159,504.43	-3,902,630.78

产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	41,021,685.54	-4,866,690.64	36,154,994.90
2.基金赎回款	-46,083,820.75	6,026,195.07	-40,057,625.68
（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	53,477,199.21	-948,083.15	52,529,116.06

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	117,496,340.28	-2,126,348.95	115,369,991.33
二、本期期初净资产	117,496,340.28	-2,126,348.95	115,369,991.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-58,957,005.86	-3,323,425.55	-62,280,431.41
（一）、综合收益总额	-	-4,386,686.85	-4,386,686.85
（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）	-58,957,005.86	1,063,261.30	-57,893,744.56
其中：1.基金申购款	21,626,155.36	-2,565,740.41	19,060,414.95
2.基金赎回款	-80,583,161.22	3,629,001.71	-76,954,159.51
（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	58,539,334.42	-5,449,774.50	53,089,559.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵桂才　　郝炜　　高文

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信聚享混合型证券投资基金(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【2021】565 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《工银瑞信聚享混合型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，《工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 08 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 421,295,154.60 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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1)金融资产分类

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

(2)金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

(7)其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1)印花税

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

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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征增值税试点的通知》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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,341,071.97	870,772.73
等于：本金	1,340,856.70	870,510.08
加：应计利息	215.27	262.65
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	1,341,071.97	870,772.73

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		20,940,682.13	-	20,213,758.13	-726,924.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,607,447.42	366,064.39	25,869,491.69	-104,020.12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,607,447.42	366,064.39	25,869,491.69	-104,020.12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		46,548,129.55	366,064.39	46,083,249.82	-830,944.12
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		20,820,883.33	-	21,192,456.80	371,573.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	29,967,628.29	447,234.68	30,265,234.68	-149,628.29
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,967,628.29	447,234.68	30,265,234.68	-149,628.29
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		50,788,511.62	447,234.68	51,457,691.48	221,945.18

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-326.71	-
银行间市场	-	-
合计	-326.71	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-102.67	-
银行间市场	-	-
合计	-102.67	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12.36	3.77
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	19,843.99	22,303.47
其中：交易所市场	19,843.99	22,303.47
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	3,878.69	40,000.00
预提信息披露费	24,863.39	120,000.00
预提账户维护费	-	4,500.00
合计	48,598.43	186,807.24

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银聚享混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,958,162.99	54,958,162.99
本期申购	3,705,620.14	3,705,620.14
本期赎回（以“-”号填列）	-12,622,253.24	-12,622,253.24
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	46,041,529.89	46,041,529.89

工银聚享混合 C

项目	本期

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,581,171.43	3,581,171.43
本期申购	37,316,065.40	37,316,065.40
本期赎回（以“-”号填列）	-33,461,567.51	-33,461,567.51
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	7,435,669.32	7,435,669.32

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

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

工银聚享混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,709,365.59	1,591,609.06	-5,117,756.53
本期期初	-6,709,365.59	1,591,609.06	-5,117,756.53
本期利润	3,927,298.89	-1,211,174.02	2,716,124.87
本期基金份额交易产生的变动数	1,302,537.39	305,405.68	1,607,943.07
其中：基金申购款	-189,707.18	202,737.99	13,030.81
基金赎回款	1,492,244.57	102,667.69	1,594,912.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,479,529.31	685,840.72	-793,688.59

工银聚享混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-436,266.78	104,248.81	-332,017.97
本期期初	-436,266.78	104,248.81	-332,017.97
本期利润	467,777.33	158,284.72	626,062.05
本期基金份额交易产生的变动数	-297,133.21	-151,305.43	-448,438.64
其中：基金申购款	-4,509,637.29	-370,084.16	-4,879,721.45
基金赎回款	4,212,504.08	218,778.73	4,431,282.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-265,622.66	111,228.10	-154,394.56

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,849.64	39,370.00
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	6,818.43	16,457.82
其他	1,124.86	601.48
合计	18,792.93	56,429.30

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,822,961.51	-7,822,925.05
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	3,822,961.51	-7,822,925.05

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	69,891,936.35	69,960,033.70
减：卖出股票成本总额	65,947,763.96	77,620,932.29
减：交易费用	121,210.88	162,026.46
买卖股票差价收入	3,822,961.51	-7,822,925.05

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	832,231.90	597,495.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-311,553.88	373,559.35
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	520,678.02	971,054.85

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	39,740,119.72	71,908,140.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,047,978.55	70,492,118.45
减：应计利息总额	1,003,695.05	1,041,844.53
减：交易费用	-	617.91
买卖债券差价收入	-311,553.88	373,559.35

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	167,641.54	66,359.12
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	167,641.54	66,359.12

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,052,889.30	2,658,479.43
股票投资	-1,098,497.47	2,719,794.27
债券投资	45,608.17	-61,314.84
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	-1,052,889.30	2,658,479.43

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	126,106.44	59,477.31
基金转换费收入	48.33	424.91
合计	126,154.77	59,902.22

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	3,878.69	40,000.00
信息披露费	24,863.39	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	9,000.00	18,000.00
银行费用	1,438.30	2,064.51
合计	39,180.38	180,064.51

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	236,043.66	317,065.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,326.15	700.66
应支付基金管理人的净管理费	233,717.51	316,364.43

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.50%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,208.75	63,413.13

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

H=E×0.10%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	14,955.01	14,955.01
上海银行股份有限公司	-	6.10	6.10
合计	-	14,961.11	14,961.11
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	3,262.31	3,262.31
上海银行股份有限公司	-	37.45	37.45
合计	-	3,299.76	3,299.76

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×C 类基金份额销售服务费年费率÷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

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

上海银行股份有限公司	1,341,071.97	10,849.64	870,772.73	39,370.00

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金存在由基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用的情形。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002494	华斯股份	2024 年 12 月 30 日	重大事项	3.99	2025 年 1 月 14 日	3.60	11,500	43,550.42	45,885.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管

理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	22,711,286.98	27,533,113.58
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	22,711,286.98	27,533,113.58

注：上述评级均取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	1,341,071.97	-	-	-	1,341,071.97
结算备付金	779,208.89	-	-	-	779,208.89
存出保证金	33,844.87	-	-	-	33,844.87
交易性金融资产	25,869,491.69	-	-	20,213,758.13	46,083,249.82
买入返售金融资产	-326.71	-	-	-	-326.71
应收清算款	-	-	-	4,500,653.43	4,500,653.43
应收申购款	-	-	-	61,466.83	61,466.83
资产总计	28,023,290.71	-	-	24,775,878.39	52,799,169.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	190,360.24	190,360.24
应付管理人报酬	-	-	-	22,324.95	22,324.95
应付托管费	-	-	-	4,465.00	4,465.00
应付销售服务费	-	-	-	2,461.32	2,461.32
应交税费	-	-	-	1,843.10	1,843.10
其他负债	-	-	-	48,598.43	48,598.43
负债总计	-	-	-	270,053.04	270,053.04
利率敏感度缺口	28,023,290.71	-	-	24,505,825.35	52,529,116.06
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	870,772.73	-	-	-	870,772.73
结算备付金	43,513.99	-	-	-	43,513.99
存出保证金	20,669.77	-	-	-	20,669.77
交易性金融资产	30,265,234.68	-	-	21,192,456.80	51,457,691.48
买入返售金融资产	-102.67	-	-	-	-102.67
应收清算款	-	-	-	918,730.97	918,730.97
应收申购款	-	-	-	5,423.02	5,423.02
资产总计	31,200,088.50	-	-	22,116,610.79	53,316,699.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,296.03	10,296.03
应付管理人报酬	-	-	-	22,363.03	22,363.03
应付托管费	-	-	-	4,472.64	4,472.64
应付销售服务费	-	-	-	1,081.12	1,081.12
应交税费	-	-	-	2,119.31	2,119.31
其他负债	-	-	-	186,807.24	186,807.24

负债总计	-	-	-	227,139.37	227,139.37
利率敏感度缺口	31,200,088.50	-	-	21,889,471.42	53,089,559.92

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ）
分析	利率减少 25 基准点	26,285.34	34,200.77
	利率增加 25 基准点	-26,212.23	-34,111.15

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	20,213,758.13	38.48	21,192,456.80	39.92
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产－债券投资	25,869,491.69	49.25	30,265,234.68	57.01
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	46,083,249.82	87.73	51,457,691.48	96.93

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ）
分析	业绩比较基准增加 5%	4,104,333.14	2,760,214.99
	业绩比较基准减少 5%	-4,104,333.14	-2,760,214.99

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	20,167,873.13	21,192,456.80
第二层次	25,915,376.69	30,265,234.68
第三层次	-	-
合计	46,083,249.82	51,457,691.48

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的金融工具，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金融工具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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	20,213,758.13	38.28
	其中：股票	20,213,758.13	38.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,869,491.69	49.00
	其中：债券	25,869,491.69	49.00
	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	-326.71	-0.00
	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	2,120,280.86	4.02
8	其他各项资产	4,595,965.13	8.70
9	合计	52,799,169.10	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	99,568.00	0.19
B	采矿业	50,504.00	0.10
C	制造业	15,534,811.63	29.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,490.00	0.49
E	建筑业	506,144.00	0.96
F	批发和零售业	473,570.00	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	255,293.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	835,334.10	1.59
J	金融业	-	-

K	房地产业	203,007.00	0.39
L	租赁和商务服务业	101,192.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	646,883.40	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,152,831.00	2.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	49,584.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,546.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	20,213,758.13	38.48

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

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600857	宁波中百	6,400	59,520.00	0.11
2	002397	梦洁股份	19,700	57,918.00	0.11
3	001218	丽臣实业	3,300	56,859.00	0.11
4	300816	艾可蓝	2,200	56,430.00	0.11
5	688669	聚石化学	3,600	55,584.00	0.11
6	600697	欧亚集团	4,300	55,255.00	0.11
7	002871	伟隆股份	5,700	55,233.00	0.11
8	300889	爱克股份	4,000	55,160.00	0.11
9	300675	建科院	3,400	54,808.00	0.10
10	603045	福达合金	4,300	54,782.00	0.10
11	603798	康普顿	6,200	54,746.00	0.10
12	001226	拓山重工	2,000	54,700.00	0.10
13	002780	三夫户外	4,300	54,395.00	0.10
14	301519	舜禹股份	4,000	54,040.00	0.10
15	002857	三晖电气	4,300	54,008.00	0.10
16	301037	保立佳	5,220	53,818.20	0.10
17	002853	皮阿诺	4,900	53,753.00	0.10
18	000953	河化股份	9,600	53,664.00	0.10
19	603029	天鹅股份	3,100	53,599.00	0.10
20	688679	通源环境	5,100	53,550.00	0.10
21	301161	唯万密封	2,500	53,425.00	0.10
22	301158	德石股份	3,800	53,314.00	0.10
22	688501	青达环保	3,800	53,314.00	0.10
23	605177	东亚药业	2,700	53,190.00	0.10

24	001210	金房能源	3,800	53,086.00	0.10
25	301273	瑞晨环保	2,900	53,041.00	0.10
26	603286	日盈电子	2,700	52,866.00	0.10
27	003003	天元股份	5,500	52,855.00	0.10
28	001331	胜通能源	4,800	52,848.00	0.10
29	001202	炬申股份	3,800	52,782.00	0.10
30	300509	新美星	7,600	52,668.00	0.10
31	301235	华康医疗	2,600	52,546.00	0.10
32	600202	哈空调	11,800	52,510.00	0.10
33	002998	优彩资源	8,300	52,456.00	0.10
34	600774	汉商集团	7,000	52,430.00	0.10
35	600883	博闻科技	8,000	52,400.00	0.10
36	301298	东利机械	3,800	52,364.00	0.10
37	600423	柳化股份	17,800	52,332.00	0.10
38	688420	美腾科技	2,400	52,272.00	0.10
39	002278	神开股份	9,800	52,234.00	0.10
40	603280	南方路机	2,500	52,200.00	0.10
40	605566	福莱蒽特	2,900	52,200.00	0.10
40	605567	春雪食品	5,800	52,200.00	0.10
41	300955	嘉亨家化	3,300	52,140.00	0.10
42	605122	四方新材	4,900	52,087.00	0.10
43	603089	正裕工业	5,800	52,026.00	0.10
44	300883	龙利得	9,700	51,992.00	0.10
45	001234	泰慕士	3,100	51,987.00	0.10
46	300849	锦盛新材	3,700	51,985.00	0.10
47	002679	福建金森	6,400	51,968.00	0.10
47	600128	苏豪弘业	6,400	51,968.00	0.10
48	603137	恒尚节能	4,900	51,940.00	0.10
49	001333	光华股份	3,000	51,930.00	0.10
50	300838	浙江力诺	4,100	51,906.00	0.10
51	600356	恒丰纸业	6,800	51,884.00	0.10
52	002188	中天服务	11,500	51,865.00	0.10
53	605033	美邦股份	4,300	51,729.00	0.10
54	600444	国机通用	3,400	51,714.00	0.10
55	603139	康惠制药	3,600	51,696.00	0.10
56	003011	海象新材	3,400	51,680.00	0.10
57	301212	联盛化学	2,500	51,675.00	0.10
58	605055	迎丰股份	10,500	51,660.00	0.10
59	603937	丽岛新材	5,700	51,642.00	0.10
60	688528	秦川物联	5,900	51,625.00	0.10
61	605255	天普股份	4,100	51,619.00	0.10
62	688323	瑞华泰	4,200	51,618.00	0.10
63	300966	共同药业	3,200	51,616.00	0.10

64	002691	冀凯股份	10,200	51,612.00	0.10
65	603329	上海雅仕	4,000	51,560.00	0.10
66	301355	南王科技	3,900	51,558.00	0.10
67	301043	绿岛风	1,800	51,534.00	0.10
68	688455	科捷智能	4,700	51,512.00	0.10
69	002999	天禾股份	8,700	51,504.00	0.10
70	301108	洁雅股份	2,000	51,500.00	0.10
71	603585	苏利股份	4,300	51,471.00	0.10
72	603080	新疆火炬	3,200	51,456.00	0.10
73	002723	小崧股份	7,400	51,430.00	0.10
74	301518	长华化学	3,200	51,424.00	0.10
75	301283	聚胶股份	2,000	51,420.00	0.10
76	002921	联诚精密	4,700	51,418.00	0.10
77	603709	中源家居	4,730	51,415.10	0.10
78	300321	同大股份	2,500	51,400.00	0.10
79	301209	联合化学	1,900	51,395.00	0.10
80	688386	泛亚微透	1,700	51,374.00	0.10
81	603725	天安新材	8,000	51,360.00	0.10
82	603172	万丰股份	3,900	51,324.00	0.10
83	603041	美思德	4,800	51,312.00	0.10
84	001366	播恩集团	4,900	51,303.00	0.10
85	000586	汇源通信	5,400	51,300.00	0.10
86	603909	建发合诚	5,600	51,296.00	0.10
87	600232	金鹰股份	9,800	51,254.00	0.10
88	688092	爱科科技	2,500	51,250.00	0.10
89	301148	嘉戎技术	2,800	51,240.00	0.10
90	600082	海泰发展	18,700	51,238.00	0.10
91	688398	赛特新材	3,800	51,224.00	0.10
92	301107	瑜欣电子	2,000	51,220.00	0.10
93	002420	毅昌科技	9,700	51,216.00	0.10
94	002830	名雕股份	4,100	51,209.00	0.10
95	002910	庄园牧场	6,800	51,204.00	0.10
96	600615	丰华股份	4,600	51,198.00	0.10
97	603176	汇通集团	11,500	51,175.00	0.10
98	688021	奥福环保	4,900	51,156.00	0.10
99	001209	洪兴股份	3,000	51,150.00	0.10
100	301287	康力源	1,800	51,138.00	0.10
101	000573	粤宏远 A	17,100	51,129.00	0.10
102	002357	富临运业	7,200	51,120.00	0.10
103	688069	德林海	3,400	51,068.00	0.10
104	603151	邦基科技	5,100	51,051.00	0.10
104	603700	宁水集团	5,100	51,051.00	0.10
105	688379	华光新材	2,500	51,050.00	0.10

106	002209	达 意 隆	5,500	51,040.00	0.10
107	600235	民丰特纸	9,000	51,030.00	0.10
107	605189	富春染织	4,200	51,030.00	0.10
107	605287	德才股份	4,200	51,030.00	0.10
108	002144	宏达高科	4,900	51,009.00	0.10
109	002760	凤形股份	3,000	51,000.00	0.10
110	002492	恒基达鑫	10,600	50,986.00	0.10
111	001336	楚环科技	2,900	50,982.00	0.10
112	301002	崧盛股份	3,000	50,970.00	0.10
113	603578	三星新材	4,300	50,955.00	0.10
114	688163	赛伦生物	2,900	50,924.00	0.10
115	001368	通达创智	2,700	50,922.00	0.10
116	603161	科华控股	4,900	50,911.00	0.10
117	002887	绿茵生态	7,300	50,881.00	0.10
118	301098	金埔园林	6,400	50,880.00	0.10
119	688098	申联生物	9,300	50,871.00	0.10
120	301008	宏昌科技	2,700	50,841.00	0.10
121	603696	安记食品	6,200	50,840.00	0.10
122	002942	新农股份	3,600	50,832.00	0.10
122	603320	迪贝电气	3,600	50,832.00	0.10
123	301063	海锅股份	3,200	50,816.00	0.10
124	002687	乔治白	11,600	50,808.00	0.10
125	603332	苏州龙杰	5,900	50,799.00	0.10
126	300789	唐源电气	3,400	50,796.00	0.10
126	603326	我乐家居	8,300	50,796.00	0.10
127	003004	声迅股份	2,000	50,780.00	0.10
128	603090	宏盛股份	2,900	50,779.00	0.10
129	300549	优德精密	3,100	50,778.00	0.10
130	002826	易明医药	4,900	50,764.00	0.10
131	301167	建研设计	4,000	50,760.00	0.10
132	003030	祖名股份	3,300	50,754.00	0.10
133	002809	红墙股份	6,400	50,752.00	0.10
134	300971	博亚精工	2,500	50,750.00	0.10
135	688272	富吉瑞	3,100	50,747.00	0.10
136	300886	华业香料	2,700	50,733.00	0.10
137	301163	宏德股份	2,400	50,712.00	0.10
138	002817	黄山胶囊	8,100	50,706.00	0.10
139	300819	聚杰微纤	3,900	50,700.00	0.10
140	300958	建工修复	4,400	50,688.00	0.10
141	002591	恒大高新	10,300	50,676.00	0.10
142	301372	科净源	2,500	50,675.00	0.10
143	002968	新大正	5,500	50,655.00	0.10
144	300417	南华仪器	4,300	50,654.00	0.10

145	688203	海正生材	5,200	50,648.00	0.10
146	603182	嘉华股份	4,400	50,644.00	0.10
147	688129	东来技术	3,000	50,640.00	0.10
148	001268	联合精密	2,900	50,634.00	0.10
149	301065	本立科技	2,700	50,625.00	0.10
150	603810	丰山集团	5,600	50,624.00	0.10
151	600735	新华锦	11,100	50,616.00	0.10
152	301156	美农生物	4,000	50,600.00	0.10
153	300931	通用电梯	7,700	50,589.00	0.10
153	301288	清研环境	3,300	50,589.00	0.10
153	603017	中衡设计	6,300	50,589.00	0.10
154	600137	浪莎股份	3,600	50,580.00	0.10
155	002800	天顺股份	4,900	50,568.00	0.10
155	603685	晨丰科技	4,300	50,568.00	0.10
156	002828	贝肯能源	5,900	50,504.00	0.10
157	000633	合金投资	11,400	50,502.00	0.10
157	002767	先锋电子	3,800	50,502.00	0.10
158	300907	康平科技	2,400	50,496.00	0.10
159	301279	金道科技	2,500	50,475.00	0.10
160	002566	益盛药业	7,400	50,468.00	0.10
161	603192	汇得科技	3,400	50,456.00	0.10
162	603926	铁流股份	5,700	50,445.00	0.10
163	301512	智信精密	1,300	50,440.00	0.10
164	688357	建龙微纳	2,300	50,439.00	0.10
165	603183	建研院	13,100	50,435.00	0.10
166	300519	新光药业	3,800	50,426.00	0.10
167	300621	维业股份	5,300	50,403.00	0.10
168	000972	中基健康	18,000	50,400.00	0.10
168	300837	浙矿股份	2,500	50,400.00	0.10
168	603321	梅轮电梯	7,200	50,400.00	0.10
168	688215	瑞晟智能	2,500	50,400.00	0.10
168	688638	誉辰智能	1,800	50,400.00	0.10
169	001278	一彬科技	3,100	50,375.00	0.10
170	603150	万朗磁塑	1,900	50,369.00	0.10
171	600051	宁波联合	7,700	50,358.00	0.10
172	301515	港通医疗	2,800	50,344.00	0.10
173	603048	浙江黎明	3,400	50,320.00	0.10
174	301075	多瑞医药	2,800	50,316.00	0.10
175	301178	天亿马	1,800	50,310.00	0.10
176	300871	回盛生物	5,000	50,300.00	0.10
176	301234	五洲医疗	2,000	50,300.00	0.10
176	605155	西大门	5,000	50,300.00	0.10
177	603028	赛福天	8,300	50,298.00	0.10

178	300334	津膜科技	8,700	50,286.00	0.10
179	300961	深水海纳	5,000	50,250.00	0.10
179	688355	明志科技	3,000	50,250.00	0.10
180	300658	延江股份	9,700	50,246.00	0.10
181	301227	森鹰窗业	3,100	50,220.00	0.10
182	301003	江苏博云	2,300	50,209.00	0.10
183	688171	纬德信息	3,000	50,190.00	0.10
184	600241	时代万恒	7,500	50,175.00	0.10
185	688517	金冠电气	3,700	50,172.00	0.10
186	603860	中公高科	1,700	50,167.00	0.10
187	300626	华瑞股份	5,500	50,160.00	0.10
187	301295	美硕科技	2,400	50,160.00	0.10
187	600099	林海股份	5,700	50,160.00	0.10
188	603903	中持股份	7,800	50,154.00	0.10
189	600493	凤竹纺织	9,700	50,149.00	0.10
190	300717	华信新材	3,600	50,148.00	0.10
191	000593	德龙汇能	9,200	50,140.00	0.10
192	688466	金科环境	3,700	50,135.00	0.10
193	301126	达嘉维康	4,800	50,112.00	0.10
194	688251	井松智能	3,100	50,096.00	0.10
195	003023	彩虹集团	2,800	50,092.00	0.10
196	300246	宝莱特	7,600	50,084.00	0.10
197	300813	泰林生物	2,900	50,083.00	0.10
198	001231	农心科技	3,000	50,070.00	0.10
199	603968	醋化股份	5,400	50,058.00	0.10
200	688485	九州一轨	5,800	50,054.00	0.10
201	688193	仁度生物	1,400	50,050.00	0.10
202	002836	新宏泽	6,800	50,048.00	0.10
202	603177	德创环保	6,800	50,048.00	0.10
203	688026	洁特生物	3,900	50,037.00	0.10
204	301081	严牌股份	5,900	50,032.00	0.10
205	300610	晨化股份	5,000	50,000.00	0.10
205	301057	汇隆新材	4,000	50,000.00	0.10
206	688291	金橙子	2,600	49,972.00	0.10
207	688659	元琛科技	7,400	49,950.00	0.10
208	001373	翔腾新材	1,700	49,946.00	0.10
208	300645	正元智慧	3,400	49,946.00	0.10
209	300721	怡达股份	4,100	49,938.00	0.10
210	002105	信隆健康	10,000	49,900.00	0.09
211	603829	洛凯股份	3,700	49,876.00	0.09
212	301130	西点药业	1,900	49,875.00	0.09
213	300948	冠中生态	5,300	49,873.00	0.09
214	688616	西力科技	4,800	49,872.00	0.09

215	300371	汇中股份	5,200	49,868.00	0.09
215	688737	中自科技	2,800	49,868.00	0.09
216	688557	兰剑智能	2,600	49,842.00	0.09
217	603813	原尚股份	4,300	49,837.00	0.09
218	688511	天微电子	3,200	49,824.00	0.09
219	300935	盈建科	2,000	49,820.00	0.09
220	688038	中科通达	4,100	49,815.00	0.09
221	688078	龙软科技	1,900	49,799.00	0.09
222	300899	上海凯鑫	2,400	49,776.00	0.09
223	000590	启迪药业	7,000	49,770.00	0.09
224	605068	明新旭腾	3,700	49,765.00	0.09
225	001230	劲旅环境	3,000	49,740.00	0.09
226	301429	森泰股份	3,200	49,728.00	0.09
227	002136	安 纳 达	5,100	49,725.00	0.09
228	603282	亚光股份	3,400	49,708.00	0.09
229	002909	集泰股份	10,000	49,700.00	0.09
230	001259	利仁科技	2,300	49,680.00	0.09
230	300637	扬帆新材	5,400	49,680.00	0.09
230	603928	兴业股份	6,000	49,680.00	0.09
230	688310	迈得医疗	4,600	49,680.00	0.09
231	603073	彩蝶实业	3,400	49,674.00	0.09
232	603159	上海亚虹	3,200	49,664.00	0.09
233	603086	先达股份	11,600	49,648.00	0.09
234	603022	新通联	6,800	49,640.00	0.09
235	688450	光格科技	2,300	49,634.00	0.09
236	001228	永泰运	2,400	49,632.00	0.09
236	002806	华锋股份	4,400	49,632.00	0.09
236	300804	广康生化	2,200	49,632.00	0.09
236	301197	工大科雅	3,300	49,632.00	0.09
237	605151	西上海	3,100	49,631.00	0.09
238	300517	海波重科	5,900	49,619.00	0.09
239	603790	雅运股份	4,500	49,590.00	0.09
240	600455	博通股份	2,400	49,584.00	0.09
241	603331	百达精工	5,500	49,555.00	0.09
242	688681	科汇股份	4,600	49,542.00	0.09
243	301232	飞沃科技	2,000	49,400.00	0.09
244	300651	金陵体育	3,900	49,374.00	0.09
245	688296	和达科技	4,400	49,368.00	0.09
246	300906	日月明	1,900	49,362.00	0.09
247	301505	苏州规划	2,000	49,360.00	0.09
248	603506	南都物业	5,800	49,358.00	0.09
249	301314	科瑞思	1,400	49,350.00	0.09
250	301448	开创电气	2,400	49,344.00	0.09

251	688013	天臣医疗	2,800	49,308.00	0.09
252	603221	爱丽家居	5,400	49,302.00	0.09
253	688395	正弦电气	2,900	49,271.00	0.09
254	300126	锐奇股份	9,600	49,248.00	0.09
255	301072	中捷精工	2,600	49,244.00	0.09
256	001260	坤泰股份	3,100	49,228.00	0.09
257	600689	上海三毛	4,600	49,220.00	0.09
258	688350	富淼科技	3,900	49,218.00	0.09
259	002696	百洋股份	10,400	49,192.00	0.09
260	300605	恒锋信息	4,200	49,182.00	0.09
261	300877	金春股份	3,500	49,175.00	0.09
262	003017	大洋生物	2,640	49,156.80	0.09
263	603637	镇海股份	5,900	49,147.00	0.09
264	603102	百合股份	1,400	49,140.00	0.09
265	301113	雅艺科技	2,100	49,098.00	0.09
266	301056	森赫股份	6,000	49,080.00	0.09
267	300640	德艺文创	8,700	49,068.00	0.09
267	300920	润阳科技	2,900	49,068.00	0.09
268	688345	博力威	2,700	49,059.00	0.09
269	688607	康众医疗	3,700	49,025.00	0.09
270	688109	品茗科技	2,000	49,020.00	0.09
271	300995	奇德新材	3,100	49,011.00	0.09
272	688718	唯赛勃	4,900	49,000.00	0.09
273	000856	冀东装备	7,100	48,990.00	0.09
274	688671	碧兴物联	2,900	48,981.00	0.09
275	600149	廊坊发展	12,000	48,960.00	0.09
275	688314	康拓医疗	1,700	48,960.00	0.09
276	002718	友邦吊顶	4,000	48,920.00	0.09
277	002883	中设股份	4,800	48,912.00	0.09
278	002778	中晟高科	2,800	48,888.00	0.09
279	301300	远翔新材	1,900	48,887.00	0.09
280	301125	腾亚精工	4,400	48,840.00	0.09
280	301276	嘉曼服饰	2,400	48,840.00	0.09
281	300780	德恩精工	3,400	48,824.00	0.09
282	301053	远信工业	2,500	48,775.00	0.09
283	301079	邵阳液压	3,200	48,768.00	0.09
284	301006	迈拓股份	3,700	48,766.00	0.09
285	301192	泰祥股份	2,800	48,748.00	0.09
286	301022	海泰科	2,400	48,720.00	0.09
287	688178	万德斯	3,900	48,711.00	0.09
288	688156	路德环境	3,600	48,708.00	0.09
289	300670	大烨智能	8,400	48,636.00	0.09
290	002890	弘宇股份	4,930	48,609.80	0.09

291	300749	顶固集创	7,900	48,585.00	0.09
292	688309	恒誉环保	3,900	48,555.00	0.09
293	300923	研奥股份	2,500	48,550.00	0.09
294	301231	荣信文化	2,700	48,546.00	0.09
295	301257	普蕊斯	1,800	48,528.00	0.09
296	688655	迅捷兴	4,500	48,510.00	0.09
297	001225	和泰机电	1,500	48,480.00	0.09
298	688393	安必平	2,800	48,468.00	0.09
299	688600	皖仪科技	3,600	48,420.00	0.09
300	301203	国泰环保	1,600	48,384.00	0.09
301	003033	征和工业	1,800	48,330.00	0.09
302	301040	中环海陆	3,900	48,321.00	0.09
303	688288	鸿泉物联	3,000	48,300.00	0.09
304	688667	菱电电控	1,200	48,228.00	0.09
305	002295	精艺股份	7,500	48,225.00	0.09
306	300710	万隆光电	2,700	48,222.00	0.09
307	300535	达威股份	3,700	48,211.00	0.09
308	300649	杭州园林	4,500	48,195.00	0.09
309	301170	锡南科技	2,100	48,132.00	0.09
310	688335	复洁环保	5,700	48,051.00	0.09
311	301198	喜悦智行	4,400	48,048.00	0.09
312	688307	中润光学	2,000	48,000.00	0.09
313	300929	华骐环保	5,800	47,966.00	0.09
314	300823	建科智能	3,680	47,876.80	0.09
315	605180	华生科技	3,900	47,853.00	0.09
316	001256	炜冈科技	3,000	47,700.00	0.09
317	300970	华绿生物	4,000	47,600.00	0.09
318	301097	天益医疗	1,300	47,580.00	0.09
319	301395	仁信新材	4,300	47,558.00	0.09
320	300845	捷安高科	3,710	47,525.10	0.09
321	002715	登云股份	3,200	47,520.00	0.09
322	300614	百川畅银	5,000	47,400.00	0.09
323	300922	天秦装备	3,300	47,355.00	0.09
324	688670	金迪克	3,900	47,268.00	0.09
325	605003	众望布艺	2,500	47,250.00	0.09
326	301258	富士莱	2,000	47,240.00	0.09
327	301390	经纬股份	1,400	47,138.00	0.09
328	688022	瀚川智能	4,300	47,128.00	0.09
329	301469	恒达新材	2,000	47,000.00	0.09
330	301359	东南电子	2,100	46,998.00	0.09
331	003008	开普检测	2,620	46,950.40	0.09
332	301555	惠柏新材	2,000	46,940.00	0.09
333	688113	联测科技	1,659	46,899.93	0.09

334	688067	爱威科技	2,800	46,816.00	0.09
335	688058	宝兰德	1,700	46,750.00	0.09
336	688056	莱伯泰科	1,600	46,656.00	0.09
337	301353	普莱得	1,700	46,648.00	0.09
338	003027	同兴科技	3,100	46,624.00	0.09
339	688329	艾隆科技	3,400	46,546.00	0.09
340	300665	飞鹿股份	7,500	46,500.00	0.09
341	300854	中兰环保	3,800	46,436.00	0.09
342	603908	牧高笛	2,100	46,410.00	0.09
343	002205	国统股份	5,200	46,332.00	0.09
344	001266	宏英智能	2,000	46,320.00	0.09
345	300594	朗进科技	2,700	46,278.00	0.09
346	688118	普元信息	2,200	46,266.00	0.09
347	688265	南模生物	2,000	46,240.00	0.09
348	688060	云涌科技	1,300	46,163.00	0.09
349	002494	华斯股份	11,500	45,885.00	0.09
350	300305	裕兴股份	8,300	45,235.00	0.09
351	688448	磁谷科技	1,600	45,008.00	0.09
352	688328	深科达	3,000	44,940.00	0.09
353	002842	翔鹭钨业	7,200	44,712.00	0.09
354	001211	双枪科技	2,300	44,620.00	0.08
355	603261	立航科技	1,600	44,480.00	0.08
356	603059	倍加洁	1,900	44,327.00	0.08
357	003042	中农联合	3,100	44,175.00	0.08
358	688573	信宇人	2,800	43,652.00	0.08
359	002873	新天药业	4,600	43,562.00	0.08
360	301237	和顺科技	1,800	43,200.00	0.08
361	001255	博菲电气	1,500	42,585.00	0.08
362	688260	昀冢科技	3,000	41,850.00	0.08
363	301105	鸿铭股份	1,500	41,700.00	0.08
364	301272	英华特	1,200	41,412.00	0.08
365	301131	聚赛龙	1,200	41,400.00	0.08
366	301388	欣灵电气	1,800	41,382.00	0.08
367	600319	亚星化学	8,400	40,320.00	0.08
368	300106	西部牧业	4,500	39,510.00	0.08
369	301027	华蓝集团	2,000	32,120.00	0.06
370	002084	海鸥住工	10,000	28,800.00	0.05
371	300635	中达安	2,000	19,580.00	0.04

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)

	码			
1	603908	牧高笛	273,499.00	0.52
2	603079	圣达生物	270,761.00	0.51
3	300721	怡达股份	262,953.00	0.50
4	301209	联合化学	262,277.00	0.49
5	002857	三晖电气	237,845.00	0.45
6	301163	宏德股份	232,841.00	0.44
7	301446	福事特	232,501.00	0.44
8	002806	华锋股份	226,256.00	0.43
9	300961	深水海纳	224,335.00	0.42
10	300897	山科智能	222,322.00	0.42
11	002357	富临运业	219,392.00	0.41
12	001209	洪兴股份	216,456.00	0.41
13	688600	皖仪科技	214,879.45	0.40
14	300670	大烨智能	214,077.00	0.40
15	300675	建科院	209,821.00	0.40
16	688314	康拓医疗	209,622.54	0.39
17	000985	大庆华科	209,461.00	0.39
18	688511	天微电子	208,925.06	0.39
19	003004	声迅股份	208,280.00	0.39
20	002715	登云股份	207,693.00	0.39

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

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603079	圣达生物	321,308.00	0.61
2	300721	怡达股份	301,365.00	0.57
3	300897	山科智能	300,911.60	0.57
4	301209	联合化学	298,819.00	0.56
5	000985	大庆华科	285,463.00	0.54
6	300901	中胤时尚	282,835.00	0.53
7	301163	宏德股份	272,381.00	0.51
8	301055	张小泉	268,931.00	0.51
9	300270	中威电子	267,508.00	0.50
10	301233	盛帮股份	264,989.00	0.50
11	002857	三晖电气	260,732.00	0.49
12	301446	福事特	260,034.40	0.49
13	300961	深水海纳	255,323.00	0.48
14	603908	牧高笛	245,398.00	0.46
15	002357	富临运业	245,029.52	0.46

16	603955	大千生态	243,852.00	0.46
17	001209	洪兴股份	242,391.00	0.46
18	002806	华锋股份	242,332.00	0.46
19	301226	祥明智能	242,212.00	0.46
20	301388	欣灵电气	240,482.00	0.45

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

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	66,067,562.76
卖出股票收入（成交）总额	69,891,936.35

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,158,204.71	6.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	22,711,286.98	43.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,869,491.69	49.25

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

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	185384	22 邮政 04	20,000	2,043,564.60	3.89
2	137626	22 粤港 03	15,000	1,520,006.38	2.89
3	137931	22 苏交 02	15,000	1,515,667.81	2.89
4	019698	23 国债 05	11,000	1,123,650.00	2.14
5	143293	18 川发 02	10,000	1,031,159.45	1.96

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	33,844.87
2	应收清算款	4,500,653.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	61,466.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,595,965.13

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	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（%）
工银聚享混合 A	330	139,519.79	42,872,544.37	93.12	3,168,985.52	6.88
工银聚享混合 C	370	20,096.40	3,738,079.38	50.27	3,697,589.94	49.73
合计	700	76,396.00	46,610,623.75	87.16	6,866,575.46	12.84

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	工银聚享混合 A	9,739.42	0.02
	工银聚享混合 C	19,275.61	0.26
	合计	29,015.03	0.05

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	工银聚享混合 A	0~10
	工银聚享混合 C	0

	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	工银聚享混合 A	0~10
	工银聚享混合 C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银聚享混合 A	工银聚享混合 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 24 日）基金份额总额	421,294,549.26	605.34
本报告期期初基金份额总额	54,958,162.99	3,581,171.43
本报告期基金总申购份额	3,705,620.14	37,316,065.40
减：本报告期基金总赎回份额	12,622,253.24	33,461,567.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,041,529.89	7,435,669.32

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人

自 2024 年 11 月 8 日起，赵紫英女士不再担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

根据管理人发布的公告，本基金自 2024 年 11 月 25 日起改聘会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本基金报告期内应支付其审计费用 3,878.69 元，该审计机构自改聘之日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 7 月 8 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正并暂停办理相关业务行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。公司所有业务均正常开展。
其他	-
措施 2	**内容**
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 9 月 5 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措	公司已完成整改。公司所有业务均正常

施的情况（如提出整改意见）	开展。
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券	2	135,959,499.11	100.00	77,542.58	100.00	-

注：1.交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准

a)财务状况良好。

b)经营行为规范。

c)合规记录优良。

d)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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	38,824,222.35	100.00	1,064,974,000.00	100.00	-	-

注：11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况章节的报告期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于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	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 3 月 20 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 4 月 3 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 4 月 12 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 6 月 12 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性	中国证监会规定的媒介	2024 年 6 月 26 日

	公告		
8	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 7 月 3 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富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 7 月 6 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 8 月 23 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 9 月 6 日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 9 月 13 日
13	工银瑞信基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 10 月 9 日
14	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	2024 年 11 月 9 日
15	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 11 月 27 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信聚享混合型证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信聚享混合型证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信聚享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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日