

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金	
基金简称	工银美丽城镇股票	
基金主代码	001043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	704,260,474.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
下属分级基金的交易代码	001043	011478
报告期末下属分级基金的份额总额	655,858,822.00 份	48,401,652.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在全面推进新型城镇化发展的背景下，积极选择深度受益于此类主题的股票进行投资，并通过积极有效的风险防范措施，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	$80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中债综合财富（总值）指数收益率}$ 。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	李申
	联系电话	400-811-9999	021-60637102

电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	400-811-9999	021-60637111
传真	010-66583158	021-60635778
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	赵桂才	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
本期已实现收益	85,104,129.48	548,882.30
本期利润	176,272,874.87	7,917,815.37
加权平均基金份额本期利润	0.3882	0.5870
本期加权平均净值利润率	14.49%	21.13%

本期基金份额净值增长率	17.24%	2.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	927,538,677.66	68,288,772.05
期末可供分配基金份额利润	1.4142	1.4109
期末基金资产净值	1,913,281,849.48	141,017,444.81
期末基金份额净值	2.917	2.913
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	191.70%	2.57%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 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

工银美丽城镇股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.89%	0.99%	-1.57%	0.64%	3.46%	0.35%
过去三个月	15.62%	1.12%	3.07%	0.78%	12.55%	0.34%

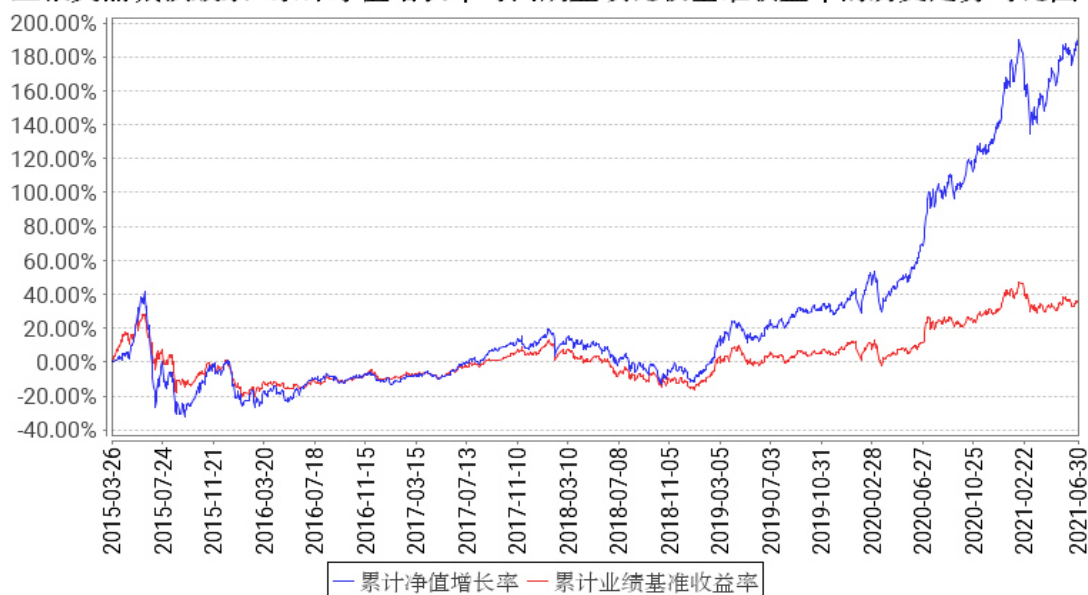
过去六个月	17.24%	1.54%	0.78%	1.05%	16.46%	0.49%
过去一年	68.61%	1.43%	20.98%	1.06%	47.63%	0.37%
过去三年	184.03%	1.40%	42.83%	1.09%	141.20%	0.31%
自基金合同生效起至今	191.70%	1.66%	35.76%	1.19%	155.94%	0.47%

工银美丽城镇股票 C

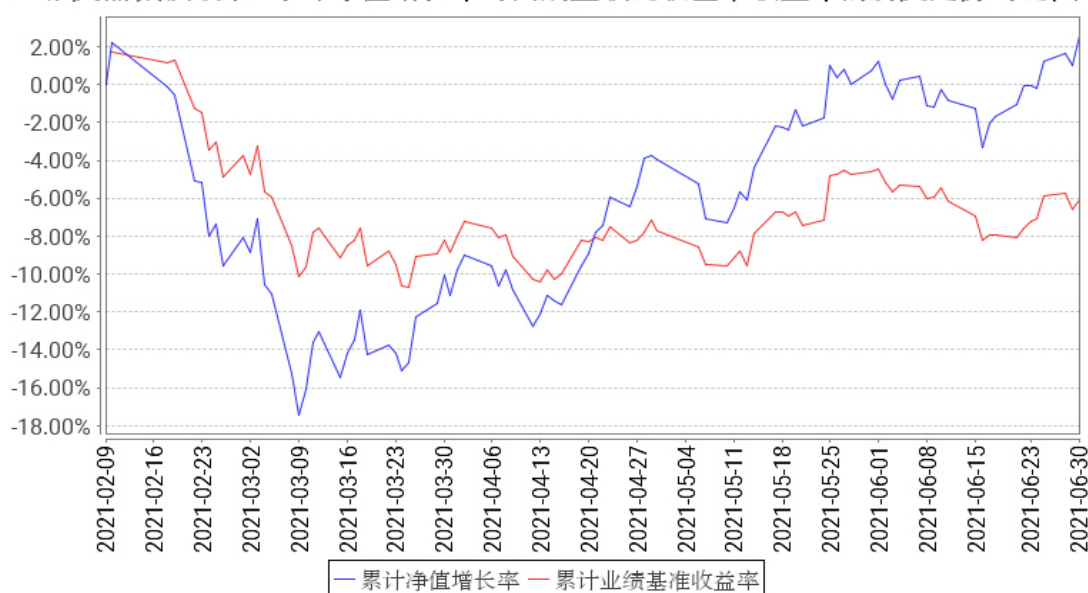
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.85%	0.99%	-1.57%	0.64%	3.42%	0.35%
过去三个月	15.46%	1.11%	3.07%	0.78%	12.39%	0.33%
自基金合同生效起至今	2.57%	1.57%	-6.09%	1.03%	8.66%	0.54%

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

工银美丽城镇股票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



工银美丽城镇股票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 2015 年 3 月 26 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，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：股票占基金资产的比例为 80% - 95%，其中投资于本基金界定的美丽城镇主题范围内股票不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

3、本基金自 2021 年 2 月 9 日增加 C 类份额类别。

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

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，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。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、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。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 6 个月定期开放混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金、工银瑞信战略远见混合型证券投资基金、工银瑞信中证科技龙头 ETF 基金、工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金等逾 180 只公募基金。

公司始终坚持“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，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

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		
王 君 正	研究部副总监，本基金的基金经理	2015 年 3 月 26 日	-	13 年	曾任泰达宏利基金管理有限公司研究员；2011 年加入工银瑞信，现任研究部副总监、金融地产研究团队负责人。2013 年 8 月 26 日至今，担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2015 年 1 月 27 日至 2018 年 2 月 27 日，担任工银国企改革主题股票型基金基金经理；2015 年 3 月 19 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银瑞信新金融股票型基金基金经理；2015 年 3 月 26 日至今，担任工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月 22 日至今，担任工银丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 11 月 14 日至今，担任工银瑞信精选金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2019

					年 2 月 11 日至今，担任工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金经理；2020 年 11 月 24 日至今，担任工银瑞信优质成长混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合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 6 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

回顾上半年，IMF 和世界银行陆续调高了 2021 年的全球和中国经济增长预期，通胀预期见顶回落，流动性环境保持平稳，市场情绪在波动后逐渐回升。上半年市场分化较大，短期基本面保持景气且长期逻辑没有瑕疵的行业反弹至高位甚至创新高，如 CXO、医疗服务、光伏、半导体、锂电池；而短期景气度较差，或者长期逻辑持续性存疑的行业则走势较弱，如保险和周期成长类标的。

操作上，上半年增持电子、银行，减持非银、家电。

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 17.24%，本基金 C 份额净值增长率为 2.57%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 0.78%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-6.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，增长压力可能逐渐显现，流动性环境仍可保持平稳，系统性风险有限。但在部分标的已经计入较高的确定性预期的情况下，市场很可能再次面临年初的部分股票性价比不足的问题。管理人将在警惕这部分股票估值风险的基础上，寻找业绩保持较快增长、同时估值处于相对洼地的股票。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 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，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	329,754,320.82	155,631,847.46
结算备付金		3,810,026.90	2,119,645.13
存出保证金		295,841.10	203,208.83
交易性金融资产	6.4.7.2	1,742,147,893.99	729,886,610.22
其中：股票投资		1,741,887,476.69	729,886,487.29
基金投资		-	-
债券投资		260,417.30	122.93
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,172,384.67	-
应收利息	6.4.7.5	32,027.75	12,002.93
应收股利		-	-
应收申购款		3,672,789.36	39,107,396.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,081,885,284.59	926,960,711.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		7,515,945.61	61,897,491.78
应付赎回款		16,420,730.90	1,649,345.20
应付管理人报酬		2,166,196.64	889,680.96
应付托管费		361,032.76	148,280.14
应付销售服务费		42,401.73	-
应付交易费用	6.4.7.7	868,983.13	495,011.46
应交税费		0.78	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	210,698.75	190,348.72
负债合计		27,585,990.30	65,270,158.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	704,260,474.79	346,376,792.21

未分配利润	6.4.7.10	1,350,038,819.50	515,313,760.96
所有者权益合计		2,054,299,294.29	861,690,553.17
负债和所有者权益总计		2,081,885,284.59	926,960,711.43

注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额为 704,260,474.79 份，其中工银美丽城镇股票 A 基金份额总额为 655,858,822.00 份，基金份额净值 2.917 元；工银美丽城镇股票 C 基金份额总额为 48,401,652.79 份，基金份额净值 2.913 元。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		198,023,766.21	148,235,021.83
1. 利息收入		383,093.53	287,736.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	353,385.00	241,354.08
债券利息收入		295.98	524.58
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		29,412.55	45,857.45
证券出借利息收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		97,826,190.54	100,059,811.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	90,520,154.02	96,302,094.72
基金投资收益	—	—	—
债券投资收益	6.4.7.13	580,129.87	293,326.82
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	—	—
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	6,725,906.65	3,464,389.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	98,537,678.46	47,744,019.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,276,803.68	143,455.18
减：二、费用		13,833,075.97	8,520,701.24

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,272,061.61	4,387,491.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,545,343.59	731,248.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	70,059.57	—
4. 交易费用	6.4.7.19	2,825,019.55	3,286,511.92
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 税金及附加		1.07	1.87
7. 其他费用	6.4.7.20	120,590.58	115,447.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		184,190,690.24	139,714,320.59
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		184,190,690.24	139,714,320.59

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	346,376,792.21	515,313,760.96	861,690,553.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	184,190,690.24	184,190,690.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	357,883,682.58	650,534,368.30	1,008,418,050.88
其中：1. 基金申购款	534,137,722.76	929,104,444.59	1,463,242,167.35
2. 基金赎回款	-176,254,040.18	-278,570,076.29	-454,824,116.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值	—	—	—

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	704,260,474.79	1,350,038,819.50	2,054,299,294.29
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	470,188,504.19	171,007,551.77	641,196,055.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	139,714,320.59	139,714,320.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-114,128,687.17	-50,732,966.25	-164,861,653.42
其中：1. 基金申购款	42,679,764.86	18,242,657.10	60,922,421.96
2. 基金赎回款	-156,808,452.03	-68,975,623.35	-225,784,075.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	356,059,817.02	259,988,906.11	616,048,723.13

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。

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

郝炜

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

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]96 号文《关于准予工银瑞信美丽城镇主题股

票型证券投资基金注册的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2015 年 3 月 26 日正式生效，首次设立募集规模为 2,380,276,036.62 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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

(1) 印花税

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

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

(2) 增值税

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生

的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	329,754,320.82
定期存款	-
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	-
合计	329,754,320.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,486,437,787.40	1,741,887,476.69	255,449,689.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	260,400.00	260,417.30
	银行间市场	-	-
	合计	260,400.00	260,417.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,486,698,187.40	1,742,147,893.99	255,449,706.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	30,166.16
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,714.50
应收债券利息	13.89
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	133.20
合计	32,027.75

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	868,983.13
银行间市场应付交易费用	—
合计	868,983.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	49,458.90
应付证券出借违约金	—
预提审计费	97,232.48
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	210,698.75

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银美丽城镇股票 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	346,376,792.21	346,376,792.21
本期申购	480,834,832.67	480,834,832.67

本期赎回（以“-”号填列）	-171,352,802.88	-171,352,802.88
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	655,858,822.00	655,858,822.00

工银美丽城镇股票 C

项目	本期 2021 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	53,302,890.09	53,302,890.09
本期赎回（以“-”号填列）	-4,901,237.30	-4,901,237.30
-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	48,401,652.79	48,401,652.79

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

工银美丽城镇股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	420,407,709.33	94,906,051.63	515,313,760.96
本期利润	85,104,129.48	91,168,745.39	176,272,874.87
本期基金份额交易产生的变动数	422,026,838.85	143,809,552.80	565,836,391.65
其中：基金申购款	652,095,119.36	183,565,149.79	835,660,269.15
基金赎回款	-230,068,280.51	-39,755,596.99	-269,823,877.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	927,538,677.66	329,884,349.82	1,257,423,027.48

工银美丽城镇股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	548,882.30	7,368,933.07	7,917,815.37
本期基金份额	67,739,889.75	16,958,086.90	84,697,976.65

交易产生的变动数			
其中：基金申购款	74,621,626.04	18,822,549.40	93,444,175.44
基金赎回款	-6,881,736.29	-1,864,462.50	-8,746,198.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,288,772.05	24,327,019.97	92,615,792.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	333,541.93
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	17,795.86
其他	2,047.21
合计	353,385.00

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	90,520,154.02
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	90,520,154.02

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	895,054,445.92
减：卖出股票成本总额	804,534,291.90
买卖股票差价收入	90,520,154.02

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	580,129.87
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	580,129.87

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,745,520.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,165,100.00
减：应收利息总额	291.12
买卖债券差价收入	580,129.87

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,725,906.65
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	6,725,906.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	98,537,678.46

股票投资	98,537,684.09
债券投资	-5.63
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	98,537,678.46

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,217,518.96
基金转换费收入	59,284.72
合计	1,276,803.68

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,825,019.55
银行间市场交易费用	-
合计	2,825,019.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	19,850.73
合计	120,590.58

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
中国建设银行股份有限公司	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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,272,061.61	4,387,491.35
其中：支付销售机构的客户维护费	1,622,789.84	956,368.83

注：1、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年管理费率为 } 1.50\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2、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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,545,343.59	731,248.53

注：1、在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年托管费率为 } 0.25\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2、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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	—	43,368.37	43,368.37
合计	—	43,368.37	43,368.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 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 0.50% 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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	329,754,320.82	333,541.93	61,912,847.95	216,083.52

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(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688680	海优新材	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	69.94	243.61	2,795	195,482.30	680,889.95	-
688626	翔宇医疗	2021 年 3 月 23 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	698	33,036.34	175,868.08	-
688345	博力威	2021 年 6 月 3 日	2021 年 12 月 13 日	新股锁定	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-
688456	有研粉材	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 17 日	新股锁定	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

688676	金盘科技	2021 年 3 月 2 日	2021 年 9 月 9 日	新股锁 定	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁 定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688655	迅捷兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁 定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未 上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁 定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

		日	日							
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁 定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁 定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁 定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股锁 定	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁 定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁 定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中	2021 年	2021 年	新股未	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

	港	6月29日	7月7日	上市						
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-

300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁 定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股锁 定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁 定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁 定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁 定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁 定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021 年 6 月 24 日	2021 年 7 月 12 日	新债未上市	100.00	100.00	2,603	260,300.00	260,300.00	-

注：以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、信用风险管理团队、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时，对于每一战略环节、业务环节，公司都制定了系统化的风险管理程序，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由三大防线共同筑成的风险管理体系。其中：

(1) 各业务部门是风险管理的第一道防线，将管控好风险作为开展业务的前提和保障，落实各项风险管理措施，承担风险管理的第一责任。第一道防线按照法律法规的规定，制定本业务条线的制度和流程，对经营和业务流程中的风险主动识别、评估和控制，收集和报告风险点，针对薄弱环节及时进行完善。通过对业务和产品相关制度、流程、系统的自我评估、自我检查、自我

完善、自我培训，履行业务经营过程中的自我风险控制职能。

(2) 风险管理部、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查等，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

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

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

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

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。本基金通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	260,417.30	122.93
未评级	-	-
合计	260,417.30	122.93

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券、同业存单、资产支持证券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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。

本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。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 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	329,754,320.82	-	-	-	-	-	329,754,320.82
结算备付金	3,810,026.90	-	-	-	-	-	3,810,026.90
存出保证金	295,841.10	-	-	-	-	-	295,841.10
交易性金融资产	-	-	-	-	260,417.30	1,741,887,476.69	1,742,147,893.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,172,384.67	2,172,384.67
应收利息	-	-	-	-	-	32,027.75	32,027.75
应收申购款	-	-	-	-	-	3,672,789.36	3,672,789.36
资产总计	333,860,188.82	-	-	-	260,417.30	1,747,764,678.47	2,081,885,284.59
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,515,945.61	7,515,945.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,420,730.90	16,420,730.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,166,196.64	2,166,196.64
应付托管费	-	-	-	-	-	361,032.76	361,032.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	42,401.73	42,401.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	868,983.13	868,983.13
应付税费	-	-	-	-	-	0.78	0.78
其他负债	-	-	-	-	-	210,698.75	210,698.75
负债总计	-	-	-	-	-	27,585,990.30	27,585,990.30
利率敏感度缺口	333,860,188.82	-	-	-	260,417.30	1,720,178,688.17	2,054,299,294.29
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	155,631,847.46	-	-	-	-	-	155,631,847.46
结算备付金	2,119,645.13	-	-	-	-	-	2,119,645.13
存出保证金	203,208.83	-	-	-	-	-	203,208.83
交易性金融资	-	-	-	-	122.93	729,886.4	729,886.61

产						87.29	0.22
应收利息	-	-	-	-	-	12,002.93	12,002.93
应收申购款	-	-	-	-	-	39,107,396.86	39,107,396.86
资产总计	157,954,701.42	-	-	-	122.93	769,005,887.08	926,960,711.43
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	61,897,491.78	61,897,491.78
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,649,345.20	1,649,345.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	889,680.96	889,680.96
应付托管费	-	-	-	-	-	148,280.14	148,280.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	495,011.46	495,011.46
其他负债	-	-	-	-	-	190,348.72	190,348.72
负债总计	-	-	-	-	-	65,270,158.26	65,270,158.26
利率敏感度缺口	157,954,701.42	-	-	-	122.93	703,735,728.82	861,690,553.17

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	利率增加 25 基准点	-3,705.19	-1.72
	利率减少 25 基准点	3,768.39	1.75

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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,741,887,476.69	84.79	729,886,487.29	84.70
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	260,417.30	0.01	122.93	—
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	1,742,147,893.99	84.80	729,886,610.22	84.70

注：1、本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 80% - 95%，其中投资于本基金界定的美丽城镇主题范围内股票不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

2、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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	142,401,033.07	50,978,397.14
	业绩比较基准减少 5%	-142,401,033.07	-50,978,397.14

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,741,887,476.69	83.67
	其中：股票	1,741,887,476.69	83.67
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	260,417.30	0.01
	其中：债券	260,417.30	0.01
	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	333,564,347.72	16.02
8	其他各项资产	6,173,042.88	0.30
9	合计	2,081,885,284.59	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	180,561.90	0.01
B	采矿业	19,913,405.00	0.97
C	制造业	1,103,292,786.64	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,651,075.23	0.57
E	建筑业	184,996.72	0.01
F	批发和零售业	6,043,865.64	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	53,500.99	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,069,113.08	2.92
J	金融业	287,166,105.39	13.98
K	房地产业	50,208,592.34	2.44
L	租赁和商务服务业	19,226,402.06	0.94
M	科学研究和技术服务业	106,231,973.16	5.17
N	水利、环境和公共设施管理业	227,753.57	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,429.70	0.00
Q	卫生和社会工作	74,834,140.63	3.64
R	文化、体育和娱乐业	2,584,774.64	0.13
S	综合	-	-
	合计	1,741,887,476.69	84.79

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	300750	宁德时代	222,600	119,046,480.00	5.79
2	002142	宁波银行	2,642,021	102,959,558.37	5.01
3	000858	五粮液	341,700	101,789,013.00	4.95
4	002415	海康威视	1,316,010	84,882,645.00	4.13
5	600519	贵州茅台	34,801	71,575,216.70	3.48
6	600926	杭州银行	3,659,440	53,976,740.00	2.63
7	603259	药明康德	340,918	53,384,349.62	2.60
8	300059	东方财富	1,600,912	52,493,904.48	2.56
9	000799	酒鬼酒	188,600	48,206,160.00	2.35
10	300015	爱尔眼科	605,504	42,978,673.92	2.09
11	002568	百润股份	449,006	42,561,278.74	2.07
12	002410	广联达	573,402	39,106,016.40	1.90
13	002430	杭氧股份	1,110,791	38,422,260.69	1.87
14	002179	中航光电	466,838	36,889,538.76	1.80
15	000001	平安银行	1,524,500	34,484,190.00	1.68
16	601838	成都银行	2,532,900	32,015,856.00	1.56
17	300122	智飞生物	154,400	28,831,112.00	1.40
18	300347	泰格医药	147,000	28,415,100.00	1.38
19	603678	火炬电子	411,300	27,762,750.00	1.35
20	002409	雅克科技	314,332	25,460,892.00	1.24
21	300274	阳光电源	210,221	24,188,028.26	1.18
22	688016	心脉医疗	52,786	23,997,043.46	1.17
23	603501	韦尔股份	67,500	21,735,000.00	1.06
24	002791	坚朗五金	105,600	20,491,680.00	1.00
25	300699	光威复材	269,500	20,468,525.00	1.00
26	603986	兆易创新	106,200	19,954,980.00	0.97
27	600399	抚顺特钢	1,086,600	19,710,924.00	0.96
28	603456	九洲药业	395,300	19,203,674.00	0.93
29	300595	欧普康视	178,640	18,498,172.00	0.90
30	688202	美迪西	34,035	17,694,796.50	0.86
31	300917	特发服务	632,379	17,491,603.14	0.85
32	603345	安井食品	68,535	17,409,260.70	0.85
33	002390	信邦制药	1,582,300	16,582,504.00	0.81
34	601088	中国神华	826,900	16,141,088.00	0.79
35	300327	中颖电子	168,100	14,327,163.00	0.70
36	300759	康龙化成	65,300	14,169,447.00	0.69
37	600132	重庆啤酒	68,400	13,539,780.00	0.66
38	002968	新大正	310,124	13,505,900.20	0.66
39	002027	分众传媒	1,388,500	13,065,785.00	0.64
40	600570	恒生电子	129,800	12,103,850.00	0.59

41	300601	康泰生物	78,300	11,666,700.00	0.57
42	600900	长江电力	559,400	11,546,016.00	0.56
43	600036	招商银行	207,300	11,233,587.00	0.55
44	002049	紫光国微	72,800	11,225,032.00	0.55
45	300012	华测检测	346,300	11,040,044.00	0.54
46	300760	迈瑞医疗	21,142	10,149,217.10	0.49
47	300661	圣邦股份	39,500	9,982,835.00	0.49
48	300458	全志科技	110,500	9,686,430.00	0.47
49	688012	中微公司	56,949	9,448,978.08	0.46
50	600183	生益科技	398,800	9,335,908.00	0.45
51	603127	昭衍新药	49,297	9,058,323.75	0.44
52	601155	新城控股	216,800	9,018,880.00	0.44
53	603486	科沃斯	39,469	9,002,089.52	0.44
54	000333	美的集团	119,500	8,528,715.00	0.42
55	688008	澜起科技	130,895	8,165,230.10	0.40
56	000661	长春高新	18,422	7,129,314.00	0.35
57	600196	复星医药	95,700	6,902,841.00	0.34
58	603799	华友钴业	60,424	6,900,420.80	0.34
59	300454	深信服	26,000	6,746,480.00	0.33
60	300482	万孚生物	103,090	6,668,892.10	0.32
61	688981	中芯国际	99,086	6,125,496.52	0.30
62	600809	山西汾酒	13,400	6,003,200.00	0.29
63	000002	万科 A	243,300	5,792,973.00	0.28
64	002223	鱼跃医疗	151,900	5,791,947.00	0.28
65	688002	睿创微纳	56,026	5,593,075.58	0.27
66	600298	安琪酵母	96,500	5,247,670.00	0.26
67	601888	中国中免	16,100	4,831,610.00	0.24
68	600600	青岛啤酒	41,400	4,787,910.00	0.23
69	002371	北方华创	16,700	4,632,246.00	0.23
70	600276	恒瑞医药	67,728	4,603,472.16	0.22
71	688122	西部超导	69,515	4,509,438.05	0.22
72	600048	保利地产	365,300	4,398,212.00	0.21
73	603233	大参林	85,314	4,360,398.54	0.21
74	600346	恒力石化	157,800	4,140,672.00	0.20
75	002304	洋河股份	19,100	3,957,520.00	0.19
76	688007	光峰科技	92,702	3,882,359.76	0.19
77	601899	紫金矿业	389,300	3,772,317.00	0.18
78	688189	南新制药	77,457	3,586,259.10	0.17
79	002254	泰和新材	165,100	3,346,577.00	0.16
80	688200	华峰测控	6,278	2,971,565.74	0.14
81	300529	健帆生物	33,995	2,935,808.20	0.14
82	300413	芒果超媒	37,000	2,538,200.00	0.12

83	688656	浩欧博	33,190	2,468,340.30	0.12
84	688169	石头科技	1,914	2,413,554.00	0.12
85	688180	君实生物	24,885	2,020,910.85	0.10
86	002475	立讯精密	43,722	2,011,212.00	0.10
87	002044	美年健康	198,761	1,810,712.71	0.09
88	603882	金域医学	10,200	1,629,654.00	0.08
89	300726	宏达电子	21,200	1,494,388.00	0.07
90	603198	迎驾贡酒	33,400	1,479,620.00	0.07
91	300119	瑞普生物	40,700	1,376,474.00	0.07
92	603369	今世缘	24,800	1,343,168.00	0.07
93	002010	传化智联	170,300	1,313,013.00	0.06
94	603444	吉比特	2,400	1,272,000.00	0.06
95	603939	益丰药房	22,620	1,268,755.80	0.06
96	300003	乐普医疗	34,600	1,111,352.00	0.05
97	601567	三星医疗	47,300	1,007,490.00	0.05
98	002709	天赐材料	9,200	980,536.00	0.05
99	603659	璞泰来	6,700	915,220.00	0.04
100	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.03
101	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.03
102	688050	爱博医疗	1,599	604,070.22	0.03
103	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.02
104	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.02
105	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.02
106	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
107	603129	春风动力	2,200	272,976.00	0.01
108	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
109	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.01
110	300957	贝泰妮	773	196,244.83	0.01
111	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.01
112	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
113	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.01
114	688308	欧科亿	2,457	166,510.89	0.01
115	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.01
116	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.01
117	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
118	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.01
119	300896	爱美客	184	145,153.92	0.01
120	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.01
121	688661	和林微纳	1,452	136,705.80	0.01
122	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
123	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.01
124	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01

125	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
126	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.01
127	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.01
128	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.01
129	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
130	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.01
131	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.01
132	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.01
133	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.01
134	688580	伟思医疗	631	105,692.50	0.01
135	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.01
136	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
137	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.00
138	688329	艾隆科技	1,846	100,902.36	0.00
139	688636	智明达	918	97,583.40	0.00
140	688699	明微电子	333	95,011.56	0.00
141	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.00
142	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.00
143	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.00
144	300948	冠中生态	3,230	92,896.54	0.00
145	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.00
146	688526	科前生物	2,533	91,745.26	0.00
147	688111	金山办公	230	90,804.00	0.00
148	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
149	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.00
150	688660	电气风电	10,206	89,812.80	0.00
151	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.00
152	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.00
153	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.00
154	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.00
155	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.00
156	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.00
157	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.00
158	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.00
159	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
160	300979	华利集团	946	83,329.40	0.00
161	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.00
162	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.00
163	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
164	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.00
165	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.00
166	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00

167	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.00
168	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.00
169	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.00
170	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.00
171	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.00
172	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.00
173	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
174	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
175	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.00
176	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
177	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.00
178	688317	之江生物	899	58,390.05	0.00
179	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.00
180	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
181	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.00
182	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
183	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.00
184	300910	瑞丰新材	536	56,038.80	0.00
185	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.00
186	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
187	688630	芯碁微装	694	53,493.52	0.00
188	300894	火星人	779	52,972.00	0.00
189	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
190	688269	凯立新材	371	51,761.92	0.00
191	300861	美畅股份	609	51,344.79	0.00
192	688788	科思科技	348	50,592.24	0.00
193	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
194	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
195	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
196	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.00
197	300887	谱尼测试	536	47,913.04	0.00
198	688658	悦康药业	2,085	46,891.65	0.00
199	300973	立高食品	393	46,770.60	0.00
200	002343	慈文传媒	9,241	46,574.64	0.00
201	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
202	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
203	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.00
204	688613	奥精医疗	467	42,398.93	0.00
205	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
206	688079	美迪凯	2,086	40,948.18	0.00
207	688686	奥普特	89	40,139.00	0.00
208	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00

209	688085	三友医疗	870	37,958.10	0.00
210	688538	和辉光电	9,834	37,467.54	0.00
211	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
212	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
213	300900	广联航空	982	36,707.16	0.00
214	688083	中望软件	66	36,451.80	0.00
215	688221	前沿生物	1,685	35,587.20	0.00
216	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
217	688093	世华科技	879	34,949.04	0.00
218	688696	极米科技	42	34,944.00	0.00
219	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
220	688665	四方光电	248	33,765.20	0.00
221	688677	海泰新光	306	33,507.00	0.00
222	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
223	300911	亿田智能	483	33,462.24	0.00
224	300872	天阳科技	902	32,742.60	0.00
225	688425	铁建重工	5,338	32,668.56	0.00
226	688619	罗普特	1,144	31,460.00	0.00
227	688360	德马科技	1,188	31,101.84	0.00
228	688059	华锐精密	185	31,061.50	0.00
229	300941	创识科技	589	29,692.06	0.00
230	688390	固德威	85	28,390.00	0.00
231	605077	华康股份	618	28,193.16	0.00
232	688133	泰坦科技	88	27,972.56	0.00
233	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
234	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
235	300864	南大环境	477	26,239.77	0.00
236	688335	复洁环保	745	25,642.90	0.00
237	688313	仕佳光子	1,392	25,236.96	0.00
238	688667	菱电电控	224	24,642.24	0.00
239	300884	狄耐克	878	23,600.64	0.00
240	300925	法本信息	897	23,582.13	0.00
241	300937	药易购	434	23,559.04	0.00
242	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
243	300873	海晨股份	533	22,817.73	0.00
244	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
245	003028	振邦智能	432	22,291.20	0.00
246	002928	华夏航空	1,435	21,668.50	0.00
247	300877	金春股份	586	21,547.22	0.00
248	300891	惠云钛业	1,225	21,302.75	0.00
249	688005	容百科技	172	20,846.40	0.00
250	300908	仲景食品	347	20,677.73	0.00

251	688063	派能科技	104	20,467.20	0.00
252	688678	福立旺	840	19,908.00	0.00
253	688668	鼎通科技	603	19,748.25	0.00
254	688109	品茗股份	254	19,720.56	0.00
255	300932	三友联众	618	19,652.22	0.00
256	300890	翔丰华	354	19,328.40	0.00
257	300868	杰美特	625	19,131.25	0.00
258	300878	维康药业	406	18,948.02	0.00
259	688698	伟创电气	947	18,930.53	0.00
260	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
261	300913	兆龙互连	700	18,340.00	0.00
262	688608	恒玄科技	56	17,746.96	0.00
263	688339	亿华通	61	17,244.70	0.00
264	688560	明冠新材	714	17,207.40	0.00
265	688669	聚石化学	523	17,149.17	0.00
266	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00
267	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
268	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
269	300940	南极光	368	16,038.26	0.00
270	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
271	000568	泸州老窖	66	15,572.04	0.00
272	300907	康平科技	524	15,416.08	0.00
273	688819	天能股份	343	15,260.07	0.00
274	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
275	300968	格林精密	1,220	14,941.74	0.00
276	688777	中控技术	155	14,593.25	0.00
277	300892	品渥食品	314	14,406.32	0.00
278	300725	药石科技	90	14,301.90	0.00
279	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
280	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
281	605169	洪通燃气	950	13,898.50	0.00
282	300952	恒辉安防	498	13,656.48	0.00
283	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
284	300879	大叶股份	560	13,540.80	0.00
285	002997	瑞鹄模具	751	13,487.96	0.00
286	300895	铜牛信息	395	13,433.95	0.00
287	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
288	300876	蒙泰高新	395	13,054.75	0.00
289	003025	思进智能	427	12,959.45	0.00
290	603267	鸿远电子	100	12,792.00	0.00
291	300933	中辰股份	1,217	12,720.18	0.00
292	300999	金龙鱼	149	12,659.04	0.00

293	300922	天秦装备	363	12,643.29	0.00
294	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
295	300961	深水海纳	536	12,183.10	0.00
296	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
297	300893	松原股份	534	11,918.88	0.00
298	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
299	300889	爱克股份	486	11,809.80	0.00
300	300918	南山智尚	1,126	11,721.66	0.00
301	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
302	300950	德固特	286	11,320.49	0.00
303	300882	万胜智能	642	11,202.90	0.00
304	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
305	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
306	688356	键凯科技	33	10,840.50	0.00
307	300931	通用电梯	813	10,702.14	0.00
308	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
309	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
310	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
311	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
312	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
313	688408	中信博	50	10,040.00	0.00
314	688578	艾力斯	304	10,022.88	0.00
315	300866	安克创新	59	9,880.73	0.00
316	300639	凯普生物	290	9,572.90	0.00
317	300881	盛德鑫泰	306	9,421.74	0.00
318	688618	三旺通信	219	9,355.68	0.00
319	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
320	003004	声迅股份	306	8,613.90	0.00
321	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
322	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
323	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
324	688065	凯赛生物	77	8,076.53	0.00
325	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
326	688386	泛亚微透	133	7,813.75	0.00
327	688550	瑞联新材	79	7,202.43	0.00
328	003009	中天火箭	123	7,143.84	0.00
329	300815	玉禾田	200	6,966.00	0.00
330	300886	华业香料	213	6,907.59	0.00
331	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
332	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
333	003031	中瓷电子	122	6,673.40	0.00
334	688679	通源环境	497	6,550.46	0.00

335	688136	科兴制药	171	6,340.68	0.00
336	688521	芯原股份	80	6,237.60	0.00
337	300142	沃森生物	100	6,170.00	0.00
338	688311	盟升电子	82	5,986.00	0.00
339	688017	绿的谐波	38	5,331.02	0.00
340	688510	航亚科技	196	5,154.80	0.00
341	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
342	688529	豪森股份	170	4,350.30	0.00
343	603155	新亚强	87	3,957.63	0.00
344	300858	科拓生物	51	3,884.67	0.00
345	000906	浙商中拓	300	3,882.00	0.00
346	688330	宏力达	51	3,699.03	0.00
347	002727	一心堂	100	3,311.00	0.00
348	688229	博睿数据	43	3,256.39	0.00
349	688256	寒武纪	23	3,178.60	0.00
350	000739	普洛药业	100	2,940.00	0.00
351	688057	金达莱	84	2,630.88	0.00
352	688160	步科股份	60	2,519.40	0.00
353	688590	新致软件	135	2,497.50	0.00
354	300903	科翔股份	75	2,404.50	0.00
355	002884	凌霄泵业	103	2,398.87	0.00
356	688338	赛科希德	41	2,278.78	0.00
357	600030	中信证券	91	2,269.54	0.00
358	688556	高测股份	96	2,213.76	0.00
359	688519	南亚新材	56	2,114.56	0.00
360	688557	兰剑智能	60	2,019.00	0.00
361	003027	同兴环保	73	1,989.25	0.00
362	688096	京源环保	129	1,973.70	0.00
363	605100	华丰股份	49	1,954.12	0.00
364	300837	浙矿股份	37	1,701.63	0.00
365	300862	蓝盾光电	43	1,559.18	0.00
366	605016	百龙创园	45	1,438.20	0.00
367	688379	华光新材	50	1,217.00	0.00
368	688215	瑞晟智能	29	1,213.94	0.00
369	605377	华旺科技	70	1,080.80	0.00
370	600383	金地集团	100	1,024.00	0.00
371	300880	迦南智能	38	963.68	0.00
372	605333	沪光股份	70	958.30	0.00
373	003003	天元股份	56	797.44	0.00
374	688513	苑东生物	17	765.85	0.00
375	688569	铁科轨道	41	765.06	0.00
376	688559	海目星	24	725.52	0.00

377	605183	确成股份	41	717.50	0.00
378	688378	奥来德	11	710.60	0.00
379	688056	莱伯泰科	10	686.00	0.00
380	688127	蓝特光学	22	611.82	0.00
381	605116	奥锐特	42	588.84	0.00
382	300846	首都在线	31	563.58	0.00
383	688551	科威尔	11	550.88	0.00
384	688596	正帆科技	27	537.30	0.00
385	003035	南网能源	46	457.24	0.00
386	688155	先惠技术	3	357.30	0.00
387	000977	浪潮信息	12	337.56	0.00
388	300865	大宏立	11	330.88	0.00
389	688585	上纬新材	22	233.20	0.00
390	688055	龙腾光电	28	220.36	0.00
391	688577	浙海德曼	3	155.04	0.00
392	300883	龙利得	11	133.98	0.00
393	300920	润阳科技	3	101.04	0.00
394	688156	路德环境	2	36.84	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	300750	宁德时代	84,088,112.80	9.76
2	600519	贵州茅台	83,351,490.00	9.67
3	000858	五粮液	69,765,565.37	8.10
4	002415	海康威视	60,624,704.30	7.04
5	002142	宁波银行	60,165,212.08	6.98
6	300059	东方财富	51,435,731.56	5.97
7	600926	杭州银行	50,037,007.76	5.81
8	603259	药明康德	47,584,053.34	5.52
9	300015	爱尔眼科	40,455,539.35	4.69
10	002410	广联达	35,727,542.86	4.15
11	000001	平安银行	33,338,846.76	3.87
12	601838	成都银行	32,289,546.00	3.75
13	300122	智飞生物	29,680,448.00	3.44
14	000799	酒鬼酒	29,591,680.83	3.43
15	300529	健帆生物	28,979,758.13	3.36
16	002568	百润股份	28,765,883.05	3.34
17	002430	杭氧股份	26,807,716.87	3.11
18	002179	中航光电	26,301,605.40	3.05
19	002044	美年健康	25,635,071.34	2.97

20	603345	安井食品	24,945,124.00	2.89
21	000568	泸州老窖	24,869,475.35	2.89
22	300601	康泰生物	24,737,638.83	2.87
23	300347	泰格医药	23,469,480.85	2.72
24	002027	分众传媒	22,194,672.32	2.58
25	300482	万孚生物	21,966,471.20	2.55
26	300917	特发服务	21,388,562.22	2.48
27	603678	火炬电子	20,998,476.80	2.44
28	300699	光威复材	19,744,987.17	2.29
29	603501	韦尔股份	19,115,816.80	2.22
30	601155	新城控股	18,899,393.00	2.19
31	002390	信邦制药	18,755,132.00	2.18
32	688016	心脉医疗	17,985,491.72	2.09
33	600900	长江电力	17,896,598.58	2.08
34	603986	兆易创新	17,579,497.38	2.04

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	601601	中国太保	46,902,323.43	5.44
2	601318	中国平安	41,758,637.45	4.85
3	000568	泸州老窖	36,648,534.71	4.25
4	300529	健帆生物	27,588,614.23	3.20
5	300482	万孚生物	27,381,038.72	3.18
6	600519	贵州茅台	27,072,891.60	3.14
7	300363	博腾股份	26,925,658.62	3.12
8	002044	美年健康	26,738,676.46	3.10
9	300122	智飞生物	25,334,346.00	2.94
10	300274	阳光电源	24,086,646.94	2.80
11	688202	美迪西	20,405,142.04	2.37
12	600036	招商银行	19,036,390.00	2.21
13	000661	长春高新	16,332,688.00	1.90
14	000333	美的集团	15,349,633.00	1.78
15	000001	平安银行	15,182,370.00	1.76
16	000799	酒鬼酒	13,494,394.00	1.57
17	603233	大参林	12,940,804.55	1.50
18	002385	大北农	12,795,382.94	1.48
19	603027	千禾味业	12,788,437.10	1.48
20	002410	广联达	12,659,281.00	1.47

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	1,717,997,597.21
卖出股票收入（成交）总额	895,054,445.92

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	260,417.30	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	260,417.30	0.01

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

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123117	健帆转债	2,603	260,300.00	0.01
2	123064	万孚转债	1	117.30	0.00

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	295,841.10
2	应收证券清算款	2,172,384.67
3	应收股利	—
4	应收利息	32,027.75
5	应收申购款	3,672,789.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,173,042.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123064	万孚转债	117.30	0.00

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
工银美丽 城镇股票 A	25,910	25,312.96	491,147,312.65	74.89	164,711,509.35	25.11
工银美丽 城镇股票 C	12,241	3,954.06	31,080,080.10	64.21	17,321,572.69	35.79
合计	38,151	18,459.82	522,227,392.75	74.15	182,033,082.04	25.85

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	工银美丽城镇股票 A	448,309.33	0.07
	工银美丽城镇股票 C	29,669.93	0.06
	合计	477,979.26	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	工银美丽城镇股票 A	0~10
	工银美丽城镇股票 C	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	工银美丽城镇股票 A	10~50
	工银美丽城镇股票 C	—
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银美丽城镇股票 A	工银美丽城镇股票 C
基金合同生效日 (2015 年 3 月 26 日) 基金份额总额	2,380,276,036.62	—
本报告期期初基金份额总额	346,376,792.21	—
本报告期基金总申购份额	480,834,832.67	53,302,890.09
减：本报告期基金总赎回份额	171,352,802.88	4,901,237.30
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期末基金份额总额	655,858,822.00	48,401,652.79

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

基金管理人于 2021 年 1 月 16 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，朱碧艳女士自 2021 年 1 月 15 日起代任工银瑞信基金管理有限公司董事长、总经理。

基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，赵桂才先生自 2021 年 2 月 5 日起担任工银瑞信基金管理有限公司董事长，并代任总经理、法定代表人。

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
天风证券	2	788,413,212.85	30.28%	560,798.46	33.57%	—
申万宏源	1	744,820,788.77	28.60%	455,309.44	27.25%	—
长江证券	1	390,359,299.87	14.99%	238,626.85	14.28%	—
国金证券	1	233,403,188.58	8.96%	142,679.55	8.54%	—
中信证券	1	176,345,115.25	6.77%	107,798.60	6.45%	—
国泰君安	1	136,658,254.79	5.25%	83,539.67	5.00%	—
中泰证券	2	134,130,159.06	5.15%	81,994.35	4.91%	—

长城证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。

b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。

c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

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
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,745,520.99	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 1 日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 5 日
3	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 16 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 29 日
5	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	2021 年 2 月 6 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金增加 C 类份额，投资范围增加存托凭证并修改基金合同、托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 2 月 9 日
7	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金调整申购、赎回业务规则的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 6 月 15 日

8	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金调整申购、赎回业务规则的公告	中国证监会规定的媒介	2021 年 6 月 17 日
---	------------------------------------	------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金自 2021 年 2 月 9 日增加 C 类份额，投资范围增加存托凭证，并相应修改《基金合同》、《托管协议》，详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日