

工银瑞信优质成长混合型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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）	14
6.1 资产负债表	14
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	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58

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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信优质成长混合型证券投资基金	
基金简称	工银优质成长混合	
基金主代码	010088	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,955,147,772.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银优质成长混合 A	工银优质成长混合 C
下属分级基金的交易代码	010088	010089
报告期末下属分级基金的份额总额	2,780,491,925.12 份	174,655,846.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于优质的成长型上市公司，充分分享中国经济增长以及企业持续成长带来的回报，追求基金资产的长期稳健增值。
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，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断国内及香港证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例。本基金界定的优质成长企业是具有长期可持续成长潜力、估值合理或被低估、具备盈利能力的上市企业，该类企业通常符合经济发展趋势或产业升级转型方向、行业形势良好成长空间较大、具有良好的内部治理结构和企业文化、具备领先的商业经营模式或核心技术优势，在市场中拥有核心竞争力。本基金以此来精选股票构建股票投资组合。本基金主要从长期成长性和盈利能力两个方面来界定优质成长上市公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	工银瑞信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95599
传真	010-66583158	010-68121816
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 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	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	赵桂才	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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)	
	工银优质成长混合 A	工银优质成长混合 C
本期已实现收益	311,983,722.38	15,039,133.32
本期利润	545,350,684.66	22,157,588.56
加权平均基金份额本期利润	0.1222	0.1015
本期加权平均净	11.61%	9.67%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	9.89%	9.45%
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	207,181,933.48	12,101,373.05
期末可供分配基金份额利润	0.0745	0.0693
期末基金资产净值	3,114,290,731.32	194,692,024.03
期末基金份额净值	1.1201	1.1147
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	12.01%	11.47%

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 2020 年 11 月 24 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银优质成长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.43%	0.98%	-1.45%	0.62%	1.88%	0.36%

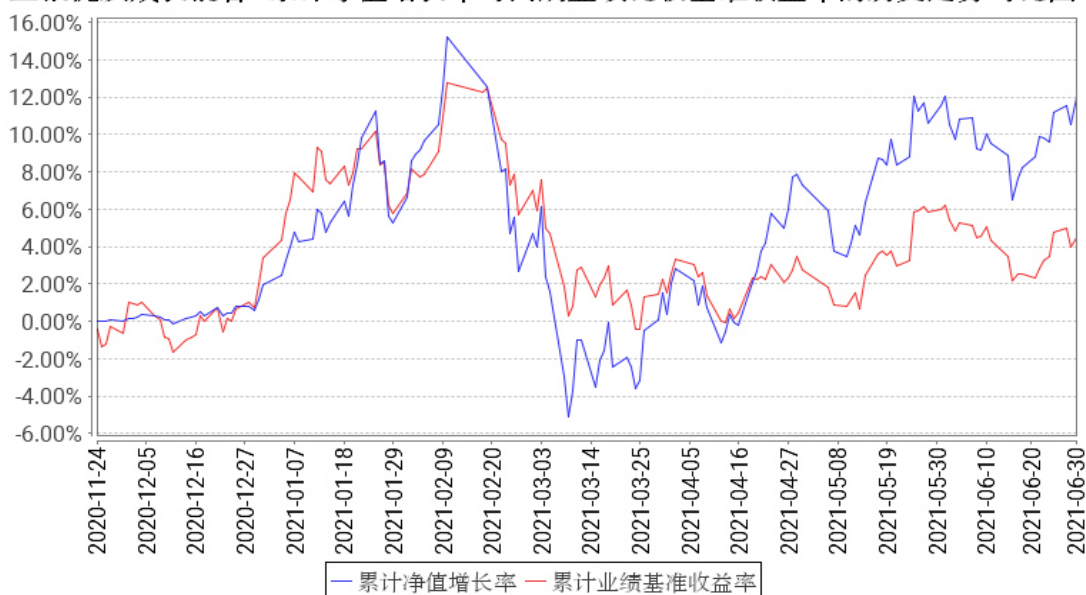
过去三个月	11.59%	1.10%	2.91%	0.76%	8.68%	0.34%
过去六个月	9.89%	1.44%	1.03%	1.02%	8.86%	0.42%
自基金合同生效起 至今	12.01%	1.30%	4.47%	0.97%	7.54%	0.33%

工银优质成长混合 C

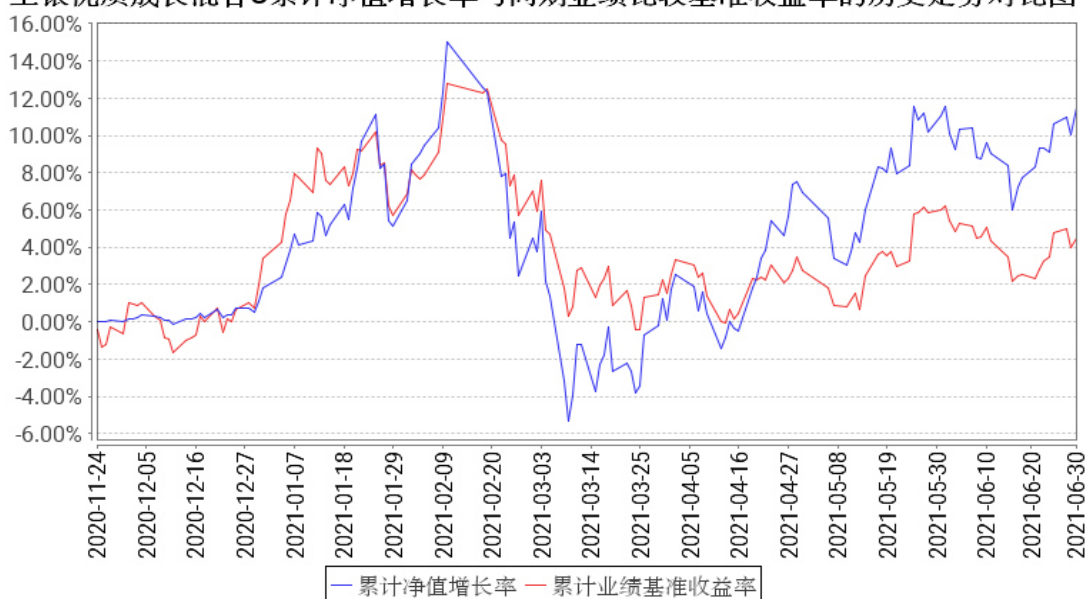
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标准 差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	0.36%	0.97%	-1.45%	0.62%	1.81%	0.35%
过去三个月	11.36%	1.10%	2.91%	0.76%	8.45%	0.34%
过去六个月	9.45%	1.44%	1.03%	1.02%	8.42%	0.42%
自基金合同生效起 至今	11.47%	1.30%	4.47%	0.97%	7.00%	0.33%

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

工银优质成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



工银优质成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 11 月 24 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，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：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%，其中投资于本基金界定的优质成长企业股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金投资港股通投资标的股票的比例占基金股票资产的比例为 0%-50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、应收申购款等。

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	2020 年 11 月 24 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，上半年增持食品饮料、银行、电力设备，减持非银、医药。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为 9.89%，本基金 C 份额净值增长率为 9.45%，业绩比较基准收益率为 1.03%。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信优质成长混合型证券投资基金

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	579,961,852.66	4,602,813,792.43
结算备付金		3,115,263.30	163,743,506.88
存出保证金		1,641,703.35	474,294.30
交易性金融资产	6.4.7.2	2,824,138,722.43	3,050,943,874.10
其中：股票投资		2,823,635,422.43	3,050,943,874.10
基金投资		-	-
债券投资		503,300.00	-
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		48,591,553.54	-
应收利息	6.4.7.5	111,019.72	1,062,601.49
应收股利		344,506.02	-
应收申购款		997,301.52	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,458,901,922.54	7,819,038,069.20
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		4.61	388,423,648.29
应付赎回款		141,757,559.44	-
应付管理人报酬		4,320,317.26	9,278,025.55
应付托管费		720,052.85	1,546,337.59
应付销售服务费		128,608.12	179,329.84
应付交易费用	6.4.7.7	2,379,629.87	1,925,750.83
应交税费		0.89	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	612,994.15	20,000.00
负债合计		149,919,167.19	401,373,092.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,955,147,772.10	7,277,322,521.83
未分配利润	6.4.7.10	353,834,983.25	140,342,455.27
所有者权益合计		3,308,982,755.35	7,417,664,977.10
负债和所有者权益总计		3,458,901,922.54	7,819,038,069.20

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 24 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额为 2,955,147,772.10 份，其中工银优质成长混合 A 基金份额总额为 2,780,491,925.12 份，基金份额净值 1.1201 元；工银优质成长混合 C 基金份额总额为 174,655,846.98 份，基金份额净值 1.1147 元。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信优质成长混合型证券投资基金

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
一、收入		624,553,994.47
1. 利息收入		4,982,166.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,083,960.33
债券利息收入		1,243.62
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		896,962.92
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		363,684,258.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	346,319,816.23
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,668,579.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
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	14,695,862.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	240,485,417.52
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	15,402,151.32

减：二、费用		57,045,721.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	36,962,689.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,160,448.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	916,729.43
4. 交易费用	6.4.7.19	12,834,981.67
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		4.47
7. 其他费用	6.4.7.20	170,867.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		567,508,273.22
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		567,508,273.22

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 24 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信优质成长混合型证券投资基金

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)	7,277,322,521.83	140,342,455.27	7,417,664,977.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	567,508,273.22	567,508,273.22
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)	-4,322,174,749.73	-354,015,745.24	-4,676,190,494.97
其中：1. 基金申购款	649,040,952.97	38,404,055.86	687,445,008.83
2. 基金赎回款	-4,971,215,702.70	-392,419,801.10	-5,363,635,503.80
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)	2,955,147,772.10	353,834,983.25	3,308,982,755.35
---------------------	------------------	----------------	------------------

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 24 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

工银瑞信优质成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2020]1812 号《关于准予工银瑞信优质成长混合型证券投资基金注册的批复》注册,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信优质成长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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 7,275,259,843.01 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0976 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信优质成长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,277,322,521.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,062,678.82 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信优质成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。

6.4.4.11 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所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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)本基金的基金管理人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)本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌

转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	579,961,852.66
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	579,961,852.66

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	2,431,552,182.54	2,823,635,422.43	392,083,239.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	503,300.00	503,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	503,300.00	503,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,432,055,482.54	2,824,138,722.43	392,083,239.89

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	106,554.93
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	3,656.15
应收债券利息	26.47
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	782.17
合计	111,019.72

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	2,379,629.87
银行间市场应付交易费用	—
合计	2,379,629.87

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	487,159.11
应付证券出借违约金	—
预提审计费	57,027.67
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	612,994.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银优质成长混合 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	7,013,469,493.36	7,013,469,493.36
本期申购	533,360,603.48	533,360,603.48
本期赎回（以“-”号填列）	-4,766,338,171.72	-4,766,338,171.72
-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	2,780,491,925.12	2,780,491,925.12

工银优质成长混合 C

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	263,853,028.47	263,853,028.47

本期申购	115,680,349.49	115,680,349.49
本期赎回（以“-”号填列）	-204,877,530.98	-204,877,530.98
-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	174,655,846.98	174,655,846.98

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

工银优质成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,641,298.14	146,104,807.95	135,463,509.81
本期利润	311,983,722.38	233,366,962.28	545,350,684.66
本期基金份额交易产生的变动数	-94,160,490.76	-252,854,897.51	-347,015,388.27
其中：基金申购款	9,488,841.59	21,901,402.15	31,390,243.74
基金赎回款	-103,649,332.35	-274,756,299.66	-378,405,632.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	207,181,933.48	126,616,872.72	333,798,806.20

工银优质成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-614,068.96	5,493,014.42	4,878,945.46
本期利润	15,039,133.32	7,118,455.24	22,157,588.56
本期基金份额交易产生的变动数	-2,323,691.31	-4,676,665.66	-7,000,356.97
其中：基金申购款	2,088,937.09	4,924,875.03	7,013,812.12
基金赎回款	-4,412,628.40	-9,601,540.69	-14,014,169.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,101,373.05	7,934,804.00	20,036,177.05

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	3,858,790.32
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	210,753.49
其他	14,416.52
合计	4,083,960.33

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	346,319,816.23
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	346,319,816.23

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	5,005,521,300.28
减：卖出股票成本总额	4,659,201,484.05
买卖股票差价收入	346,319,816.23

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	2,668,579.80

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	2,668,579.80

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	8,172,634.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,502,800.00
减：应收利息总额	1,254.34
买卖债券差价收入	2,668,579.80

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	14,695,862.73
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	14,695,862.73

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	240,485,417.52
股票投资	240,485,417.52
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	240,485,417.52

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	15,353,850.39
基金转换费收入	48,300.93
合计	15,402,151.32

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	12,820,386.34
银行间市场交易费用	—
港股通证券组合费	14,595.33
合计	12,834,981.67

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	57,027.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	17,000.00
银行费用	37,332.65
合计	170,867.69

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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	36,962,689.72
其中：支付销售机构的客户维护费	17,406,189.48

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	6,160,448.27	

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	工银优质成长混合 A	工银优质成长混合 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	—	17,495.97	17,495.97
中国工商银行股份有限公司	—	469,049.56	469,049.56
中国农业银行股份有限公司	—	93,827.50	93,827.50
合计	—	580,373.03	580,373.03

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 0.80% 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：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

本期						
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息

						支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	999,900,000.00	82,539.38	-	-

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	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	579,961,852.66	3,858,790.32

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	-
688660	电气风电	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 19 日	新股锁定	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88	-
688317	之江生物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新股锁定	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688059	华锐精密	2021 年 2 月 1 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	新股锁定	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688329	艾隆科技	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 3 日	新股锁定	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	-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
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	-

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	-
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
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	-
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	2021 年 12 月 2	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

		日	日							
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	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
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	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
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	2021 年	2021 年	新股锁	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

	新材	4月21日	11月1日	定						
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	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
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	-
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	5,033	503,300.00	503,300.00	-

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同责任，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	503,300.00	-
未评级	-	-
合计	503,300.00	-

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。

3、本基金上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系, 审慎评估各类资产的流动性, 针对性制定流动性风险管理措施, 对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配, 确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时, 本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致, 并咨询会计师事务所意见后, 可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制, 最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内, 本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况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	579,961,852.66	-	-	-	-	-	579,961,852.66
结算备付金	3,115,263.30	-	-	-	-	-	3,115,263.30
存出保证金	1,641,703.35	-	-	-	-	-	1,641,703.35
交易性金融资产	-	-	-	-	503,300.00	2,823,635,422.43	2,824,138,722.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-	48,591,553.54	48,591,553.54
应收利息	-	-	-	-	-	111,019.72	111,019.72
应收股利	-	-	-	-	-	344,506.02	344,506.02
应收申购款	-	-	-	-	-	997,301.52	997,301.52
资产总计	584,718,819.31	-	-	-	503,300.00	2,873,679,803.23	3,458,901,922.54
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4.61	4.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	141,757,559.44	141,757,559.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,320,317.26	4,320,317.26
应付托管费	-	-	-	-	-	720,052.85	720,052.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	128,608.12	128,608.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,379,629.87	2,379,629.87
应付税费	-	-	-	-	-	0.89	0.89
其他负债	-	-	-	-	-	612,994.15	612,994.15
负债总计	-	-	-	-	-	149,919,167.19	149,919,167.19
利率敏感度缺口	584,718,819.31	-	-	-	503,300.00	2,723,760,636.04	3,308,982,755.35

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	4,602,813,792.43	-	-	-	-	-	4,602,813,792.43
结算备付金	163,743,506.88	-	-	-	-	-	163,743,506.88
存出保证金	474,294.30	-	-	-	-	-	474,294.30
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,050,943,874.10	3,050,943,874.10
应收利息	-	-	-	-	-	1,062,601.49	1,062,601.49
资产总计	4,767,031,593.61	-	-	-	-	3,052,006,475.59	7,819,038,069.20
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	388,423,648.29	388,423,648.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,278,025.55	9,278,025.55
应付托管费	-	-	-	-	-	1,546,337.59	1,546,337.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	179,329.84	179,329.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,925,750.83	1,925,750.83
其他负债	-	-	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	401,373,092.10	401,373,092.10
利率敏感度缺口	4,767,031,593.61	-	-	-	-	2,650,633,383.49	7,417,664,977.10

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）	

			31 日)
分析	利率增加 25 基准点	-7,161.26	-
	利率减少 25 基准点	7,283.40	-

注：本基金上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	180,086,354.81	-	180,086,354.81
应收股利	-	344,506.02	-	344,506.02
资产合计	-	180,430,860.83	-	180,430,860.83
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	180,430,860.83	-	180,430,860.83
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资	-	196,857,742.00	-	196,857,742.00

产				
资产合计	-	196,857,742.00	-	196,857,742.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	196,857,742.00	-	196,857,742.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	9,021,543.04	9,842,887.10
	港币相对人民币贬值 5%	-9,021,543.04	-9,842,887.10

注：表中列示了以外币计价的资产中主要币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

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	2,823,635,422.43	85.33	3,050,943,874.10	41.13

交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	503,300.00	0.02	—	—
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	2,824,138,722.43	85.35	3,050,943,874.10	41.13

注：1、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%–95%，其中投资于本基金界定的优质成长企业股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金投资港股通投资标的股票的比例占基金股票资产的比例为 0%–50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、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。		
分析	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）
	业绩比较基准增加 5%	216,012,191.33	99,745,273.17
	业绩比较基准减少 5%	-216,012,191.33	-99,745,273.17

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	2,823,635,422.43	81.63
	其中：股票	2,823,635,422.43	81.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	503,300.00	0.01
	其中：债券	503,300.00	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	583,077,115.96	16.86
8	其他各项资产	51,686,084.15	1.49
9	合计	3,458,901,922.54	100.00

注：1、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 180,086,354.81 元，占期末资产净值比例为 5.44%。

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	207,418.70	0.01
B	采矿业	87,263.74	0.00
C	制造业	1,577,704,406.75	47.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,807,224.63	0.30
E	建筑业	3,175,729.38	0.10
F	批发和零售业	6,757,329.18	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,028,242.97	2.78
J	金融业	495,811,778.83	14.98
K	房地产业	105,317,066.47	3.18
L	租赁和商务服务业	9,588,384.36	0.29
M	科学研究和技术服务业	199,597,674.24	6.03
N	水利、环境和公共设施管理业	183,311.46	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	34,691.73	0.00
Q	卫生和社会工作	143,220,679.83	4.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,643,549,067.62	79.89

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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务 Communication Services	63,486,754.50	1.92
非必需消费品 Consumer Discretionary	6,622,970.31	0.20
必需消费品 Consumer Staples	-	-
能源 Energy	-	-
金融 Financials	75,722,301.00	2.29
保健 Health Care	23,037,779.00	0.70
工业 Industrials	-	-
信息技术 Information Technology	-	-
材料 Materials	-	-
房地产 Real Estate	11,216,550.00	0.34
公用事业 Utilities	-	-
合计	180,086,354.81	5.44

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	000858	五 粮 液	616,575	183,671,526.75	5.55
2	002142	宁波银行	4,548,852	177,268,762.44	5.36
3	300750	宁德时代	324,967	173,792,351.60	5.25
4	002415	海康威视	2,672,450	172,373,025.00	5.21
5	600926	杭州银行	7,479,011	110,315,412.25	3.33
6	000799	酒鬼酒	377,503	96,489,766.80	2.92
7	300015	爱尔眼科	1,333,866	94,677,808.68	2.86
8	300059	东方财富	2,801,700	91,867,743.00	2.78
9	600519	贵州茅台	41,364	85,073,338.80	2.57
10	603259	药明康德	514,610	80,582,779.90	2.44
11	002179	中航光电	1,014,202	80,142,242.04	2.42
12	002430	杭氧股份	2,053,838	71,042,256.42	2.15
13	002568	百润股份	747,460	70,851,733.40	2.14
14	002410	广联达	963,706	65,724,749.20	1.99
15	002409	雅克科技	795,298	64,419,138.00	1.95
16	00388	香港交易所	166,900	64,271,521.00	1.94
17	00700	腾讯控股	130,650	63,486,754.50	1.92
18	603678	火炬电子	927,400	62,599,500.00	1.89
19	000001	平安银行	2,256,471	51,041,374.02	1.54
20	300347	泰格医药	227,800	44,033,740.00	1.33
21	603456	九洲药业	884,039	42,946,614.62	1.30
22	300595	欧普康视	414,670	42,939,078.50	1.30
23	300699	光威复材	499,381	37,927,986.95	1.15
24	002791	坚朗五金	193,100	37,471,055.00	1.13
25	688202	美迪西	70,558	36,683,104.20	1.11
26	601838	成都银行	2,847,078	35,987,065.92	1.09
27	603986	兆易创新	186,100	34,968,190.00	1.06
28	300759	康龙化成	157,045	34,077,194.55	1.03
29	600036	招商银行	538,900	29,202,991.00	0.88
30	601155	新城控股	680,725	28,318,160.00	0.86
31	300917	特发服务	996,840	27,572,594.40	0.83
32	300122	智飞生物	146,947	27,439,413.31	0.83
33	603127	昭衍新药	136,602	25,100,617.50	0.76
34	002390	信邦制药	2,387,606	25,022,110.88	0.76
35	300601	康泰生物	152,852	22,774,948.00	0.69
36	603345	安井食品	89,021	22,613,114.42	0.68
37	300012	华测检测	700,905	22,344,851.40	0.68
38	600183	生益科技	901,700	21,108,797.00	0.64
39	000002	万 科 A	847,459	20,177,998.79	0.61
40	002968	新大正	458,800	19,980,740.00	0.60
41	06078	海吉亚医疗	214,200	18,179,154.00	0.55

42	603486	科沃斯	78,635	17,935,070.80	0.54
43	688016	心脉医疗	38,867	17,669,326.87	0.53
44	601799	星宇股份	77,300	17,448,156.00	0.53
45	603799	华友钴业	145,600	16,627,520.00	0.50
46	600276	恒瑞医药	232,320	15,790,790.40	0.48
47	300454	深信服	57,000	14,790,360.00	0.45
48	002475	立讯精密	314,300	14,457,800.00	0.44
49	300760	迈瑞医疗	28,300	13,585,415.00	0.41
50	01299	友邦保险	142,600	11,450,780.00	0.35
51	06989	卓越商企服务	1,591,000	11,216,550.00	0.34
52	002049	紫光国微	70,500	10,870,395.00	0.33
53	600570	恒生电子	116,369	10,851,409.25	0.33
54	300482	万孚生物	153,279	9,915,618.51	0.30
55	600900	长江电力	467,000	9,638,880.00	0.29
56	002027	分众传媒	1,012,000	9,522,920.00	0.29
57	600048	保利地产	769,732	9,267,573.28	0.28
58	603501	韦尔股份	24,100	7,760,200.00	0.23
59	002223	鱼跃医疗	194,900	7,431,537.00	0.22
60	600132	重庆啤酒	37,000	7,324,150.00	0.22
61	600346	恒力石化	276,400	7,252,736.00	0.22
62	688981	中芯国际	116,558	7,205,615.56	0.22
63	002304	洋河股份	32,000	6,630,400.00	0.20
64	03690	美团-W	24,800	6,611,680.00	0.20
65	603233	大参林	124,520	6,364,217.20	0.19
66	300327	中颖电子	74,000	6,307,020.00	0.19
67	01873	维亚生物	587,500	4,858,625.00	0.15
68	002044	美年健康	494,965	4,509,131.15	0.14
69	300661	圣邦股份	16,850	4,258,500.50	0.13
70	601668	中国建筑	638,400	2,968,560.00	0.09
71	603659	璞泰来	13,500	1,844,100.00	0.06
72	688122	西部超导	17,469	1,133,214.03	0.03
73	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.02
74	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.02
75	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
76	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.01
77	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.01
78	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
79	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
80	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
81	300957	贝泰妮	923	233,940.18	0.01
82	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.01
83	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.01

84	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.01
85	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
86	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.01
87	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.00
88	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.00
89	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.00
90	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
91	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.00
92	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.00
93	688661	和林微纳	1,452	136,705.80	0.00
94	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
95	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.00
96	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
97	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.00
98	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.00
99	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.00
100	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.00
101	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
102	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.00
103	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
104	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.00
105	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.00
106	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.00
107	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.00
108	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.00
109	688636	智明达	918	97,583.40	0.00
110	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.00
111	688456	有研粉材	3,396	93,729.60	0.00
112	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.00
113	300948	冠中生态	3,229	92,867.63	0.00
114	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.00
115	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.00
116	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
117	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.00
118	688626	翔宇医疗	729	88,092.36	0.00
119	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.00
120	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.00
121	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.00
122	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.00
123	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.00
124	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.00
125	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.00

126	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
127	300979	华利集团	946	83,329.40	0.00
128	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.00
129	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.00
130	605117	德业股份	627	80,005.20	0.00
131	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
132	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.00
133	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.00
134	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00
135	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.00
136	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.00
137	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
138	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.00
139	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.00
140	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.00
141	688676	金盘科技	3,750	62,812.50	0.00
142	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.00
143	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
144	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
145	300943	春晖智控	2,542	59,955.10	0.00
146	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
147	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.00
148	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.00
149	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
150	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.00
151	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
152	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
153	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.00
154	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.00
155	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
156	688630	芯碁微装	694	53,493.52	0.00
157	300894	火星人	779	52,972.00	0.00
158	688538	和辉光电	13,748	52,379.88	0.00
159	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
160	688269	凯立新材	371	51,761.92	0.00
161	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
162	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
163	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
164	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.00
165	688819	天能股份	1,080	48,049.20	0.00
166	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
167	300973	立高食品	393	46,770.60	0.00

168	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
169	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
170	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.00
171	688613	奥精医疗	467	42,398.93	0.00
172	688079	美迪凯	2,086	40,948.18	0.00
173	688686	奥普特	90	40,590.00	0.00
174	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
175	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
176	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
177	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
178	688083	中望软件	66	36,451.80	0.00
179	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
180	688696	极米科技	42	34,944.00	0.00
181	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
182	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
183	688665	四方光电	248	33,765.20	0.00
184	688677	海泰新光	306	33,507.00	0.00
185	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
186	688425	铁建重工	5,332	32,631.84	0.00
187	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
188	688619	罗普特	1,146	31,515.00	0.00
189	300941	创识科技	589	29,692.06	0.00
190	605077	华康股份	618	28,193.16	0.00
191	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
192	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
193	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
194	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
195	688667	菱电电控	224	24,642.24	0.00
196	300937	药易购	434	23,559.04	0.00
197	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
198	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
199	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
200	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
201	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
202	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
203	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
204	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
205	688109	品茗股份	254	19,720.56	0.00
206	300932	三友联众	618	19,652.22	0.00
207	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
208	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
209	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00

210	003032	传智教育	586	18,429.70	0.00
211	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
212	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
213	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
214	688669	聚石化学	523	17,149.17	0.00
215	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
216	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
217	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
218	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
219	300940	南极光	368	16,038.26	0.00
220	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
221	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
222	688656	浩欧博	210	15,617.70	0.00
223	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
224	300968	格林精密	1,220	14,941.74	0.00
225	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
226	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
227	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
228	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
229	300952	恒辉安防	498	13,656.48	0.00
230	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
231	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
232	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
233	300933	中辰股份	1,217	12,720.18	0.00
234	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
235	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
236	300961	深水海纳	536	12,183.10	0.00
237	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
238	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
239	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
240	300950	德固特	286	11,320.49	0.00
241	01999	敏华控股	727	11,290.31	0.00
242	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
243	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
244	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
245	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
246	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
247	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
248	300931	通用电梯	813	10,702.14	0.00
249	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
250	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
251	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00

252	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
253	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
254	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
255	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
256	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
257	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
258	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
259	688618	三旺通信	219	9,355.68	0.00
260	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
261	300529	健帆生物	100	8,636.00	0.00
262	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
263	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
264	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
265	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
266	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
267	605155	西大门	350	7,696.50	0.00
268	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
269	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
270	003031	中瓷电子	122	6,673.40	0.00
271	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
272	000568	泸州老窖	12	2,831.28	0.00
273	003035	南网能源	46	457.24	0.00
274	601318	中国平安	3	192.84	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	000858	五粮液	230,880,473.82	3.11
2	600519	贵州茅台	219,532,774.73	2.96
3	600926	杭州银行	135,559,497.96	1.83
4	00700	腾讯控股	132,016,196.07	1.78
5	300015	爱尔眼科	129,749,127.89	1.75
6	02601	中国太保	99,170,981.76	1.34
6	601601	中国太保	29,941,791.77	0.40
7	300059	东方财富	110,819,250.49	1.49
8	00388	香港交易所	100,395,724.45	1.35
9	03908	中金公司	96,540,351.37	1.30
10	300699	光威复材	93,846,351.51	1.27
11	000001	平安银行	88,489,320.84	1.19
12	002415	海康威视	86,860,224.02	1.17
13	002142	宁波银行	83,851,741.65	1.13

14	000799	酒鬼酒	83,425,761.04	1.12
15	300601	康泰生物	79,359,699.23	1.07
16	002044	美年健康	78,463,268.90	1.06
17	603345	安井食品	78,176,918.11	1.05
18	002385	大北农	73,115,993.08	0.99
19	601899	紫金矿业	70,323,866.27	0.95
20	300363	博腾股份	68,399,357.91	0.92

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	224,542,075.69	3.03
1	02601	中国太保	76,356,471.01	1.03
2	600519	贵州茅台	210,998,737.01	2.84
3	00700	腾讯控股	187,976,447.37	2.53
4	002415	海康威视	186,758,035.57	2.52
5	601318	中国平安	174,764,256.50	2.36
6	002142	宁波银行	167,813,426.03	2.26
7	300122	智飞生物	160,072,279.84	2.16
8	688202	美迪西	142,338,971.35	1.92
9	000568	泸州老窖	136,120,455.30	1.84
10	300363	博腾股份	133,117,611.72	1.79
11	603233	大参林	108,992,404.25	1.47
12	000858	五粮液	108,008,272.67	1.46
13	002044	美年健康	94,562,976.39	1.27
14	300482	万孚生物	84,809,764.62	1.14
15	002410	广联达	81,418,856.94	1.10
16	03908	中金公司	79,508,073.40	1.07
17	000799	酒鬼酒	74,283,038.63	1.00
18	601899	紫金矿业	73,332,500.49	0.99
19	300015	爱尔眼科	71,939,833.79	0.97
20	03690	美团-W	70,167,109.50	0.95

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	4,191,407,614.86
卖出股票收入（成交）总额	5,005,521,300.28

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）	503,300.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	503,300.00	0.02

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	5,033	503,300.00	0.02

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	1,641,703.35
2	应收证券清算款	48,591,553.54
3	应收股利	344,506.02
4	应收利息	111,019.72
5	应收申购款	997,301.52
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	51,686,084.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
工银优质成长混合 A	45,410	61,230.83	13,810,785.16	0.50	2,766,681,139.96	99.50
工银优质成长混合 C	4,216	41,426.91	13,902,751.16	7.96	160,753,095.82	92.04
合计	49,626	59,548.38	27,713,536.32	0.94	2,927,434,235.78	99.06

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	工银优质成长混合 A	477,415.48	0.02
	工银优质成长混合 C	306,126.20	0.18
	合计	783,541.68	0.03

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	工银优质成长混合 A	—
	工银优质成长混合 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	工银优质成长混合 A	10~50
	工银优质成长混合 C	—
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银优质成长混合 A	工银优质成长混合 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 24 日) 基金份额总额	7,013,469,493.36	263,853,028.47
本报告期期初基金份额总额	7,013,469,493.36	263,853,028.47
本报告期基金总申购份额	533,360,603.48	115,680,349.49
减: 本报告期基金总赎回份额	4,766,338,171.72	204,877,530.98
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	2,780,491,925.12	174,655,846.98

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:

2021 年 5 月, 中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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普华永道中天会计师事务所（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	
国泰君安	1	2,794,158,788.30	30.42%	1,786,033.14	28.21%	-
华西证券	2	2,496,029,366.57	27.17%	1,775,427.36	28.04%	-
国盛证券	3	1,627,887,330.49	17.72%	1,157,917.96	18.29%	-
光大证券	2	1,554,714,349.29	16.92%	1,105,870.22	17.47%	-
广发证券	3	659,400,559.94	7.18%	469,024.75	7.41%	-
国信证券	1	54,557,610.01	0.59%	37,099.17	0.59%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。

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

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

(2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

本报告期内本基金新增华西证券 48946 上海交易单元，华西证券 011725 深圳交易单元。

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	8,172,634.14	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于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	中国证监会规定的媒介	2021 年 1 月 5 日

	金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告		
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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信优质成长混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信优质成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信优质成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信优质成长混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日