

上证 180 公司治理交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	44

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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.4 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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	交银上证 180 公司治理 ETF
场内简称	治理 ETF
基金主代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
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	162,524,362.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2009 年 12 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 公司治理指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	上证 180 公司治理指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

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		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	秦一楠
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		(021) 61055054	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼	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	200120	100031
法定代表人	阮红	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,685,422.37
本期利润	5,966,287.80
加权平均基金份额本期利润	0.0366
本期加权平均净值利润率	2.59%
本期基金份额净值增长率	2.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	80,841,541.90
期末可供分配基金份额利润	0.4974
期末基金资产净值	226,840,391.84
期末基金份额净值	1.396
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	55.36%

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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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

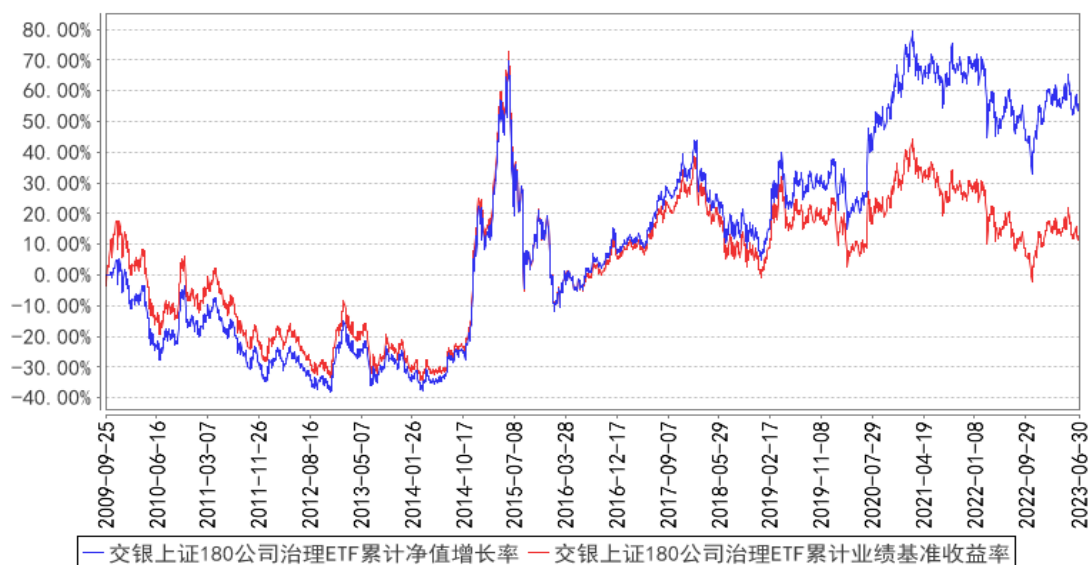
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.05%	0.75%	0.41%	0.79%	1.64%	-0.04%
过去三个月	-0.36%	0.87%	-1.71%	0.91%	1.35%	-0.04%

过去六个月	2.72%	0.85%	1.35%	0.87%	1.37%	-0.02%
过去一年	-2.92%	0.98%	-6.84%	0.99%	3.92%	-0.01%
过去三年	22.67%	1.12%	2.41%	1.14%	20.26%	-0.02%
自基金合同生效起至今	55.36%	1.40%	12.12%	1.41%	43.24%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为上证 180 公司治理指数。

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

交银上证180公司治理ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 3 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§ 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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 122 只基金，其中

股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

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		
邵文婷	交银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银中证海外中国互联网指数（QDII-LOF）、交银中证环境治理指数（LOF）、交银创业板 50 指数、交银国证新能源指数（LOF）、交银定期支付月月丰债券的基金经理	2021 年 4 月 30 日	-	7 年	邵文婷女士，中国国籍，英国诺丁汉大学金融与投资硕士、西南财经大学数学与经济学双学士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、投资经理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符

合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2023 年上半年，宏观经济运行总体呈现先回升、后趋缓态势。上半年，制造业景气度先升后降。一月至二月，国内经济加速修复，二月制造业 PMI 升至 52.6%，创近年来新高。从生产端来看，春节后企业积极复产，一月、二月生产指数连续回升。需求层面，新订单、新出口订单指数连月扩张，表明内外需均有所改善。一月至二月，非制造业亦快速修复，基建投资持续发力，拉动建筑业景气度提升，居民出行及消费意愿增强带动服务业景气度向好。三月至五月，制造业 PMI 高位回落，经济修复动能趋弱。新订单、新出口订单指数连月收缩，需求不足仍是经济复苏的主要掣肘。五月，生产指数亦降至收缩区间，表明企业生产活动有所放缓。六月，制造业 PMI 企稳，

结束前期下行走势。产需同步抬升，生产指数升至扩张区间，企业生产经营边际回暖。二季度，非制造业持续运行在扩张区间，但扩张步伐持续放缓。随着修复的回落，天气转热，服务业有所回调，经济由恢复性增长转向常态化运行。流动性方面，三月末央行全面降准 25bp、六月降息 10bp，上半年国内资金面整体平稳偏松。回顾上半年股票市场表现，年初 A 股市场快速上行，主要指数均明显上涨。二月以来，在国内经济复苏放缓、人民币汇率贬值等影响之下，A 股市场震荡下行。上半年，计算机、传媒、通信以及电子等数字经济相关板块为主要市场热点。作为跟踪基准指数的指数基金，上半年基金总体呈现宽幅震荡态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

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 2023 年下半年，政策或将延续“稳中求进”的总基调，国内经济有望进一步修复。6 月 16 日国常会表示研究推动经济持续回升向好的一批政策措施，当前经济增长动能趋缓，稳增长政策有望加码。此外，六月以来央行降息、新能源车购置税减免政策出台或将助力经济增长动能回升。预计后续产业政策的出台将对 A 股市场形成一定支撑，未来符合产业趋势、估值合理、基本面较为确定的优质标的值得关注。总体而言，从中长期来看，我们对 A 股市场维持谨慎乐观的看法。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何

外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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—交银施罗德基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德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：上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,194,346.95	4,364,313.59
结算备付金		-	9,060.47
存出保证金		1,110.34	3,626.78
交易性金融资产	6.4.7.2	221,337,583.03	218,214,390.15
其中：股票投资		221,337,583.03	218,214,390.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		228,533,040.32	222,591,390.99
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,429,542.61	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		93,394.59	94,912.35
应付托管费		18,678.94	18,982.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	151,032.34	282,528.05
负债合计		1,692,648.48	396,422.87

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	145,998,849.94	146,897,169.73
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	80,841,541.90	75,297,798.39
净资产合计		226,840,391.84	222,194,968.12
负债和净资产总计		228,533,040.32	222,591,390.99

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.396 元，基金份额总额 162,524,362.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,816,385.40	-11,684,187.22
1. 利息收入		18,824.55	19,667.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,824.55	19,667.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,516,695.42	3,026,721.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	903,525.37	-721,070.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	176,907.13
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,613,170.05	3,570,885.58
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.20	2,280,865.43	-14,730,576.24
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		850,097.60	873,288.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	572,220.85	591,555.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	114,444.19	118,311.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	163,432.56	163,422.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,966,287.80	-12,557,476.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,966,287.80	-12,557,476.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,966,287.80	-12,557,476.00

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	146,897,169.73	-	75,297,798.39	222,194,968.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	146,897,169.73	-	75,297,798.39	222,194,968.12

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-898,319.79	-	5,543,743.51	4,645,423.72
(一)、综合收益总额	-	-	5,966,287.80	5,966,287.80
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-898,319.79	-	-422,544.29	-1,320,864.08
其中：1. 基金申购款	898,319.79	-	547,784.30	1,446,104.09
2. 基金赎回款	-1,796,639.58	-	-970,328.59	-2,766,968.17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	145,998,849.94	-	80,841,541.90	226,840,391.84
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	150,490,448.88	-	102,898,490.99	253,388,939.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	150,490,448.88	-	102,898,490.99	253,388,939.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-898,319.79	-	-13,063,914.60	-13,962,234.39
(一)、综合收益总额	-	-	-12,557,476.00	-12,557,476.00
(二)、本期基金份额交易产生的	-898,319.79	-	-506,438.60	-1,404,758.39

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中: 1. 基金申 购款	-	-	-	-
2. 基金赎 回款	-898,319.79	-	-506,438.60	-1,404,758.39
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	149,592,129.09	-	89,834,576.39	239,426,705.48

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:

谢卫

印皓

单江

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

上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金(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[2009]第 795 号《关于核准上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由交银施罗德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《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,009,243,480.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 179 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,009,284,164.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 40,684.00 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中

国农业银行股份有限公司。

根据《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司确定 2009 年 12 月 4 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 公司治理指数收盘值为 938.90 点，基金资产净值为 1,054,880,523.33 元，折算前基金份额总额为 1,009,284,164.00 份，折算前基金份额净值为 1.045 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 1.11319302，折算后基金份额总额为 1,123,524,362.00 份，折算后基金份额净值为 0.939 元。交银施罗德基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2009 年 12 月 7 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2009]第 215 号文审核同意，本基金于 2009 年 12 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 180 公司治理指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证），该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金也可少量投资于新股（含存托凭证）、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为上证 180 公司治理指数。

交银施罗德基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2009 年 9 月 29 日募集成立了交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“180 公司治理 ETF 联接基金”)。180 公司治理 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度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 2023

年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。

(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。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,194,346.95
等于：本金	7,192,959.21
加：应计利息	1,387.74
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,194,346.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	211,496,358.72	-	221,337,583.03	9,841,224.31
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		211,496,358.72	-	221,337,583.03	9,841,224.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,229.78
其中：交易所市场	27,229.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	35,000.00
预提账户维护费	4,500.00
合计	151,032.34

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,524,362.00	146,897,169.73
本期申购	1,000,000.00	898,319.79
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-1,796,639.58
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	162,524,362.00	145,998,849.94

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	116,934,093.09	-41,636,294.70	75,297,798.39
本期利润	3,685,422.37	2,280,865.43	5,966,287.80
本期基金份额交易产生的变动数	-720,019.63	297,475.34	-422,544.29
其中：基金申购款	718,698.24	-170,913.94	547,784.30
基金赎回款	-1,438,717.87	468,389.28	-970,328.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	119,899,495.83	-39,057,953.93	80,841,541.90

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	18,447.54
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	365.10
其他	11.91
合计	18,824.55

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	754,129.49
股票投资收益——赎回差价收入	149,395.88
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	903,525.37

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	16,857,693.59
减：卖出股票成本总额	16,052,821.35
减：交易费用	50,742.75

买卖股票差价收入	754,129.49
----------	------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,766,968.17
减：现金支付赎回款总额	44,329.17
减：赎回股票成本总额	2,573,243.12
减：交易费用	-
赎回差价收入	149,395.88

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,613,170.05
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	3,613,170.05

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,280,865.43
股票投资	2,280,865.43
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	2,280,865.43

6.4.7.21 其他收入

替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	130.00
债券账户费用	9,000.00
指数使用费	70,000.00
合计	163,432.56

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起至 2020 年 3 月 31 日，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元；根据于 2020 年 3 月 31 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于调整上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金标的指数许可使用费并修改法律文件的公告》，自 2020 年 4 月 1 日起，如当季度基金日均资产净值大于人民币 5,000 万元，支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限调整为每季（自然季度）人民币 35,000 元；如当季度基金日均资产净值小于或等于人民币 5,000 万元，支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期内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
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“180 公司治理 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	572,220.85	591,555.22
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	114,444.19	118,311.00

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
180 公司治理 ETF 联接基金	154,424,699.00	95.02	154,424,699.00	94.44

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行_活 期存款	7,194,346.95	18,447.54	5,992,739.57	19,463.15

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位： 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
601061	中信金 属	2023 年 3 月 30 日	6 个月 以上	限售股	6.58	7.58	719	4,731.02	5,450.02	-
601065	江盐集 团	2023 年 3 月 31 日	6 个月 以上	限售股	10.36	11.84	251	2,600.36	2,971.84	-
601133	柏诚股 份	2023 年 3 月 31 日	6 个月 以上	限售股	11.66	12.26	201	2,343.66	2,464.26	-

		日									
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月以上	限售股	25.98	24.53	67	1,740.66	1,643.51		-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月以上	限售股	17.80	17.89	230	4,094.00	4,114.70		-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月以上	限售股	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月以上	限售股	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月以上	限售股	36.15	38.13	219	7,916.85	8,350.47		-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月以上	限售股	14.16	16.21	487	6,895.92	7,894.27		-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月以上	限售股	23.60	64.67	206	4,861.60	13,322.02		-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月以上	限售股	19.20	25.53	235	4,512.00	5,999.55		-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月以上	限售股	26.66	31.50	194	5,172.04	6,111.00		-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月以上	限售股	37.88	29.49	364	13,788.32	10,734.36		-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月以上	限售股	75.00	90.76	87	6,525.00	7,896.12		-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月以上	限售股	5.69	5.41	2,533	14,412.77	13,703.53		-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月以上	限售股	11.10	17.04	891	9,890.10	15,182.64		-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月以上	限售股	33.99	29.49	155	5,268.45	4,570.95		-
688484	南芯科	2023 年	6 个月	限售股	39.99	36.71	202	8,077.98	7,415.42		-

	技	3月28日	以上								
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月以上	限售股	21.86	23.85	311	6,798.46	7,417.35		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月以上	限售股	152.38	135.97	75	11,428.50	10,197.75		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月以上	限售股	35.00	51.23	156	5,460.00	7,991.88		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月以上	限售股	43.67	53.05	140	6,113.80	7,427.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月以上	限售股	12.68	22.31	444	5,629.92	9,905.64		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月以上	限售股	30.26	25.33	250	7,565.00	6,332.50		-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月以上	限售股	135.80	120.41	75	10,185.00	9,030.75		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月以上	限售股	125.80	118.03	54	6,793.20	6,373.62		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月以上	限售股	26.74	40.68	242	6,471.08	9,844.56		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月以上	限售股	11.18	14.59	587	6,562.66	8,564.33		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月以上	限售股	55.00	55.00	112	6,160.00	6,160.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,000	55,000.00	55,000.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月以上	限售股	10.68	12.34	683	7,294.44	8,428.22		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月以上	限售股	125.88	86.79	56	7,049.28	4,860.24		-

688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月 以上	限售股	9.26	18.59	660	6,111.60	12,269.40	-
--------	------	-----------------------	------------	-----	------	-------	-----	----------	-----------	---

注：1、基金可作为特定投资者，参与上市公司非公开发行股份认购，交易所主板、创业板、科创板新股申购，通过大宗交易或其他符合法律法规的交易方式取得带限售期的股票等业务，并根据各项法律法规的要求进行锁定；

2、上表所披露的受限期指自该证券实际取得之日起至可流通日之间的受限期限。

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

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 180 公司治理指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 公司治理指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内

部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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，将风险控制可在承受的范围之内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：无）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,194,346.95	-	-	-	7,194,346.95
存出保证金	1,110.34	-	-	-	1,110.34
交易性金融资产	-	-	-	-221,337,583.03	221,337,583.03
资产总计	7,195,457.29	-	-	-221,337,583.03	228,533,040.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	93,394.59	93,394.59
应付托管费	-	-	-	18,678.94	18,678.94
应付清算款	-	-	-	1,429,542.61	1,429,542.61
其他负债	-	-	-	151,032.34	151,032.34
负债总计	-	-	-	1,692,648.48	1,692,648.48
利率敏感度缺口	7,195,457.29	-	-	-219,644,934.55	226,840,391.84
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,364,313.59	-	-	-	4,364,313.59
结算备付金	9,060.47	-	-	-	9,060.47
存出保证金	3,626.78	-	-	-	3,626.78
交易性金融资产	-	-	-	-218,214,390.15	218,214,390.15
资产总计	4,377,000.84	-	-	-218,214,390.15	222,591,390.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	94,912.35	94,912.35
应付托管费	-	-	-	18,982.47	18,982.47
其他负债	-	-	-	282,528.05	282,528.05
负债总计	-	-	-	396,422.87	396,422.87
利率敏感度缺口	4,377,000.84	-	-	-217,817,967.28	222,194,968.12

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 公司治理指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，本基金投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）的资产比例，不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日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对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	221,337,583.03	97.57	218,214,390.15	98.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	221,337,583.03	97.57	218,214,390.15	98.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)

1. 业绩比较基准上 涨 5%	11, 172, 667. 22	10, 930, 570. 63
2. 业绩比较基准下 降 5%	-11, 172, 667. 22	-10, 930, 570. 63

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。”常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	221, 045, 611. 76	217, 551, 417. 09
第二层次	61, 160. 00	195, 673. 40
第三层次	230, 811. 27	467, 299. 66
合计	221, 337, 583. 03	218, 214, 390. 15

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	221,337,583.03	96.85
	其中：股票	221,337,583.03	96.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,194,346.95	3.15
8	其他各项资产	1,110.34	0.00
9	合计	228,533,040.32	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,759,836.08	10.03
C	制造业	89,995,703.62	39.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,708,715.50	6.04
E	建筑业	11,131,793.92	4.91
F	批发和零售业	1,312,286.76	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	5,127,343.79	2.26
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,873,912.44	3.91
J	金融业	64,333,934.93	28.36
K	房地产业	3,698,077.14	1.63
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	220,941,604.18	97.40

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	361,349.92	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,576.69	0.00
F	批发和零售业	5,450.02	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,476.59	0.01
J	金融业	1,231.36	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,894.27	0.00
N	水利、环境和公	-	-

	共设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	395,978.85	0.17

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	19,900	33,650,900.00	14.83
2	601318	中国平安	344,335	15,977,144.00	7.04
3	600036	招商银行	393,382	12,887,194.32	5.68
4	601166	兴业银行	462,262	7,234,400.30	3.19
5	600900	长江电力	311,040	6,861,542.40	3.02
6	601899	紫金矿业	523,600	5,953,332.00	2.62
7	600887	伊利股份	202,300	5,729,136.00	2.53
8	601398	工商银行	1,114,151	5,370,207.82	2.37
9	600309	万华化学	59,800	5,252,832.00	2.32
10	600028	中国石化	604,696	3,845,866.56	1.70
11	601668	中国建筑	666,525	3,825,853.50	1.69
12	601088	中国神华	104,780	3,221,985.00	1.42
13	600031	三一重工	188,838	3,140,375.94	1.38
14	600048	保利发展	228,259	2,974,214.77	1.31
15	600406	国电南瑞	127,635	2,948,368.50	1.30
16	600050	中国联通	606,637	2,911,857.60	1.28
17	600837	海通证券	306,900	2,829,618.00	1.25
18	601601	中国太保	108,799	2,826,598.02	1.25
19	600690	海尔智家	120,294	2,824,503.12	1.25
20	600089	特变电工	123,517	2,753,193.93	1.21
21	600436	片仔癀	9,500	2,720,420.00	1.20
22	600000	浦发银行	373,195	2,701,931.80	1.19
23	601857	中国石油	360,300	2,691,441.00	1.19
24	601988	中国银行	669,968	2,619,574.88	1.15
25	601766	中国中车	386,690	2,513,485.00	1.11

26	603288	海天味业	53,006	2,483,331.10	1.09
27	601390	中国中铁	326,484	2,474,748.72	1.09
28	600150	中国船舶	71,000	2,336,610.00	1.03
29	603986	兆易创新	21,200	2,252,500.00	0.99
30	601225	陕西煤业	123,200	2,241,008.00	0.99
31	601985	中国核电	299,935	2,114,541.75	0.93
32	600104	上汽集团	148,516	2,104,471.72	0.93
33	601919	中远海控	202,500	1,903,500.00	0.84
34	601628	中国人寿	52,920	1,850,083.20	0.82
35	600660	福耀玻璃	50,940	1,826,199.00	0.81
36	601229	上海银行	316,114	1,817,655.50	0.80
37	600585	海螺水泥	76,200	1,808,988.00	0.80
38	601989	中国重工	362,381	1,746,676.42	0.77
39	600958	东方证券	166,168	1,611,829.60	0.71
40	600019	宝钢股份	283,031	1,590,634.22	0.70
41	601186	中国铁建	146,243	1,440,493.55	0.64
42	601006	大秦铁路	188,977	1,404,099.11	0.62
43	600547	山东黄金	57,442	1,348,738.16	0.59
44	600588	用友网络	65,413	1,340,966.50	0.59
45	601939	建设银行	213,453	1,336,215.78	0.59
46	601009	南京银行	164,380	1,315,040.00	0.58
47	600011	华能国际	139,800	1,294,548.00	0.57
48	601669	中国电建	219,000	1,257,060.00	0.55
49	600196	复星医药	40,363	1,247,216.70	0.55
50	601800	中国交建	112,965	1,232,448.15	0.54
51	600886	国投电力	94,739	1,198,448.35	0.53
52	600845	宝信软件	22,864	1,161,719.84	0.51
53	600600	青岛啤酒	11,200	1,160,656.00	0.51
54	601100	恒立液压	17,000	1,093,610.00	0.48
55	600795	国电电力	283,400	1,085,422.00	0.48
56	600176	中国巨石	76,342	1,081,002.72	0.48
57	601336	新华保险	26,517	975,030.09	0.43
58	600489	中金黄金	92,372	954,202.76	0.42
59	601877	正泰电器	34,100	942,865.00	0.42
60	600741	华域汽车	50,088	924,624.48	0.41
61	601618	中国中冶	227,000	901,190.00	0.40
62	601555	东吴证券	127,273	883,274.62	0.39
63	600188	兖矿能源	29,100	870,672.00	0.38
64	600460	士兰微	27,000	817,290.00	0.36
65	600233	圆通速递	54,700	796,432.00	0.35
66	601607	上海医药	35,336	791,879.76	0.35
67	601238	广汽集团	70,391	733,474.22	0.32
68	600383	金地集团	100,397	723,862.37	0.32

69	600027	华电国际	108,200	723,858.00	0.32
70	600109	国金证券	82,800	717,876.00	0.32
71	600219	南山铝业	223,300	674,366.00	0.30
72	600875	东方电气	35,300	658,345.00	0.29
73	600160	巨化股份	42,900	591,162.00	0.26
74	601998	中信银行	97,400	582,452.00	0.26
75	600563	法拉电子	4,200	576,660.00	0.25
76	601990	南京证券	70,300	575,054.00	0.25
77	600497	驰宏锌锗	113,200	568,264.00	0.25
78	600026	中远海能	44,087	557,259.68	0.25
79	600141	兴发集团	24,700	548,834.00	0.24
80	600183	生益科技	37,200	528,240.00	0.23
81	600118	中国卫星	18,700	527,527.00	0.23
82	600153	建发股份	47,700	520,407.00	0.23
83	601966	玲珑轮胎	23,400	519,948.00	0.23
84	600549	厦门钨业	27,000	513,810.00	0.23
85	603000	人民网	17,500	511,000.00	0.23
86	601898	中煤能源	58,100	490,364.00	0.22
87	600018	上港集团	88,772	466,053.00	0.21
88	600863	内蒙华电	103,700	430,355.00	0.19
89	601222	林洋能源	45,800	375,102.00	0.17
90	603195	公牛集团	3,600	345,816.00	0.15
91	601958	金铂股份	30,700	342,305.00	0.15
92	600171	上海贝岭	18,100	330,325.00	0.15
93	600456	宝钛股份	9,100	307,944.00	0.14
94	688032	禾迈股份	867	307,915.05	0.14
95	600123	兰花科创	28,320	231,657.60	0.10
96	600062	华润双鹤	13,200	229,944.00	0.10
97	605499	东鹏饮料	1,300	224,770.00	0.10
98	601236	红塔证券	29,900	222,755.00	0.10

7.3.2 期末积极投资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	688582	芯动联科	2,420	111,883.86	0.05
2	688603	天承科技	1,112	61,160.00	0.03
3	688472	阿特斯	891	15,182.64	0.01
4	688469	中芯集成	2,533	13,703.53	0.01
5	688361	中科飞测	206	13,322.02	0.01
6	688629	华丰科技	660	12,269.40	0.01
7	688443	智翔金泰	364	10,734.36	0.00
8	688531	日联科技	75	10,197.75	0.00
9	688562	航天软件	444	9,905.64	0.00

10	688576	西山科技	75	9,030.75	0.00
11	688593	新相微	587	8,564.33	0.00
12	688620	安凯微	683	8,428.22	0.00
13	688146	中船特气	219	8,350.47	0.00
14	688535	华海诚科	156	7,991.88	0.00
15	688458	美芯晟	87	7,896.12	0.00
16	688334	西高院	487	7,894.27	0.00
17	688543	国科军工	140	7,427.00	0.00
18	688523	航天环宇	311	7,417.35	0.00
19	688484	南芯科技	202	7,415.42	0.00
20	688581	安杰思	54	6,373.62	0.00
21	688570	天玛智控	250	6,332.50	0.00
22	688433	华曙高科	194	6,111.00	0.00
23	688429	时创能源	235	5,999.55	0.00
24	601061	中信金属	719	5,450.02	0.00
25	688623	二元科技	56	4,860.24	0.00
26	688479	友车科技	155	4,570.95	0.00
27	603135	中重科技	230	4,114.70	0.00
28	601065	江盐集团	251	2,971.84	0.00
29	601133	柏诚股份	201	2,464.26	0.00
30	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
31	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
32	603125	常青科技	67	1,643.51	0.00
33	600999	招商证券	67	909.19	0.00
34	601117	中国化学	89	736.92	0.00
35	601818	光大银行	81	248.67	0.00
36	600919	江苏银行	10	73.50	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	603986	兆易创新	2,148,803.00	0.97
2	600028	中国石化	1,284,438.00	0.58
3	600519	贵州茅台	1,011,665.00	0.46
4	601899	紫金矿业	924,358.00	0.42
5	600109	国金证券	724,765.00	0.33
6	601990	南京证券	581,152.00	0.26
7	601318	中国平安	506,306.00	0.23
8	600118	中国卫星	492,148.00	0.22
9	601857	中国石油	472,088.00	0.21
10	603000	人民网	468,551.00	0.21
11	600150	中国船舶	441,075.00	0.20

12	600863	内蒙华电	421,667.00	0.19
13	600036	招商银行	402,898.00	0.18
14	603195	公牛集团	346,550.96	0.16
15	601958	金钼股份	333,835.00	0.15
16	688032	禾迈股份	305,051.04	0.14
17	601166	兴业银行	233,422.00	0.11
18	601236	红塔证券	231,864.00	0.10
19	601398	工商银行	170,255.00	0.08
20	600309	万华化学	165,686.00	0.07

注：“本期累计买入金额”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	600919	江苏银行	2,762,860.00	1.24
2	601818	光大银行	1,664,602.00	0.75
3	600999	招商证券	1,582,420.00	0.71
4	603993	洛阳钼业	1,180,001.00	0.53
5	600900	长江电力	962,822.00	0.43
6	601117	中国化学	943,983.00	0.42
7	601838	成都银行	883,290.00	0.40
8	601111	中国国航	759,215.00	0.34
9	601636	旗滨集团	454,897.00	0.20
10	688506	百利天恒	441,389.04	0.20
11	600516	方大炭素	436,503.00	0.20
12	688515	裕太微	299,011.63	0.13
13	600598	北大荒	288,867.00	0.13
14	688343	云天励飞	284,877.89	0.13
15	688435	英方软件	201,564.86	0.09
16	688502	茂莱光学	198,414.21	0.09
17	688629	华丰科技	142,308.68	0.06
18	688469	中芯集成	138,447.23	0.06
19	688361	中科飞测	132,972.66	0.06
20	688472	阿特斯	131,414.75	0.06

注：“本期累计卖出金额”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	18,041,766.92
卖出股票收入（成交）总额	16,857,693.59

注：“买入股票成本”或“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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形披露如下：

2023 年 5 月 8 日，福建证监局公示政监管措施决定书 202318 号行政处罚决定书，给予兴业银行股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

2022 年中国银行保险监督管理委员会分别公示银保监罚决字（2022）41 号及 50 号行政处罚决定书，分别给予兴业银行股份有限公司 150 万元以及 450 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 11 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2022）48 号行政处罚决定书，给予招商银行 460 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 12 月 30 日，央行公示银罚决字（2022）1 号-11 号行政处罚决定书，给予招商银行 3423.50 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 8 月 22 日，国家外汇管理局深圳市分局公示深外管检（2022）23 号行政处罚决定书，给予中国平安保险（集团）股份有限公司处罚款人民币 30 万元人民币罚款的行政处罚。

本基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对上述主体发行证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有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中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	1,110.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,110.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688603	天承科技	61,160.00	0.03	新股未上市
2	688472	阿特斯	15,182.64	0.01	限售股

3	688469	中芯集成	13,703.53	0.01	限售股
4	688361	中科飞测	13,322.02	0.01	限售股
5	688582	芯动联科	9,844.56	0.00	限售股

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,633	99,525.02	154,425,599.00	95.02	8,098,763.00	4.98

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国农业银行—交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金	154,424,699.00	95.02

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国农业银行—交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金	154,424,699.00	95.02
2	吴春霞	763,511.00	0.47
3	张苏娇	661,049.00	0.41
4	吕延华	398,177.00	0.24
5	吴炯	352,493.00	0.22
6	吴露萍	333,957.00	0.21
7	杨亮先	264,206.00	0.16
8	马国群	200,000.00	0.12
9	李全枝	165,418.00	0.10
10	虞利新	152,800.00	0.09

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00
------------------	------	------

8.4 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

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日） 基金份额总额	1,009,284,164.00
本报告期期初基金份额总额	163,524,362.00
本报告期基金总申购份额	1,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	162,524,362.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
中信证券	2	32,126,573.59	100.00	29,050.13	100.00	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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	上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 19 日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 2 月 10 日

3	上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 3 月 30 日
4	上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
中国农业银行—交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2023/1/1-2023/6/30	154,424,699.00	-	-	154,424,699.00	95.02
产品特有风险							
本基金是交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金的目标 ETF。交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金遵循指数化投资理念，以目标 ETF 为主要投资对象，正常情况下投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金本报告期内除上述联接基金外未出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总额 20%的情况。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。