

工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国证 2000ETF 基金
场内简称	国证 2000ETF 基金
基金主代码	159543
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 9 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	18,196,551.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金的股票投资主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用最优化抽样复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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@icbcs.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 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	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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,819,106.52
本期利润	-2,264,334.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0966
本期加权平均净值利润率	-11.28%
本期基金份额净值增长率	-18.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,839,537.09
期末可供分配基金份额利润	-0.2110
期末基金资产净值	14,357,013.91
期末基金份额净值	0.7890
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.10%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

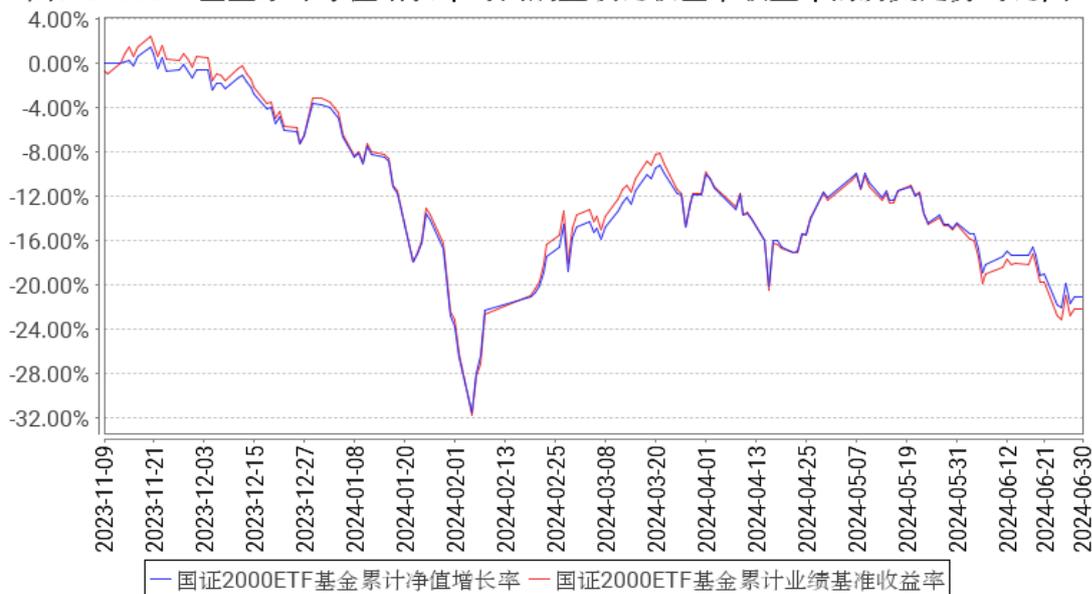
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.85%	1.45%	-8.98%	1.58%	1.13%	-0.13%
过去三个月	-10.49%	1.59%	-11.89%	1.68%	1.40%	-0.09%
过去六个月	-18.06%	2.01%	-19.67%	2.12%	1.61%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-21.10%	1.79%	-22.23%	1.91%	1.13%	-0.12%

### 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

国证2000ETF基金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 2023 年 11 月 9 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效未满 1 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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是中国工商银行控股的基金管理公司，成立于 2005 年 6 月。目前，公司在北京、上海、深圳等地设有分公司，分别在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

自成立以来，公司坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强

大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足专业化、综合化、国际化、数字化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资、绿色投资、责任投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。目前，公司（含子公司）共有员工 787 人，84%的员工拥有硕士以上学历。公司投研团队由资深基金经理和研究员组成，投研人员 215 人，投资人员平均拥有 12 年的从业经验。

经过十多年的发展，工银瑞信（含子公司）已拥有公募基金、私募资产管理计划、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金、职业年金、养老金产品等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

工银瑞信（含子公司）以持续优秀的投资业绩、完善周到的服务，为超 9000 万境内外个人和机构投资者提供涵盖公募与私募、上市与非上市、境内与跨境业务的财富管理服务，赢得了广大基金投资人、企业年金客户、私募资产管理计划客户等的认可和信赖。截至 2024 年 6 月 30 日，工银瑞信（含子公司）旗下管理 251 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模约 1.9 万亿元，养老金管理规模居行业领先。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	指数及量化投资部投资副总监、本基金的基金经理	2023 年 11 月 9 日	-	13 年	博士研究生。2010 年加入工银瑞信，曾任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理；现任指数及量化投资部投资副总监、基金经理。2014 年 10 月 17 日至 2022 年 3 月 21 日，担任工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金（自 2020 年 2 月 18 日起，变更为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2014 年 10 月 17 日至 2024 年 1 月 9 日，担任工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金（自 2018 年 4 月 17 日起，变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF））基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分

				<p>级证券投资基金(自 2020 年 11 月 26 日起, 变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金 (LOF)) 基金经理; 2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日, 担任工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理; 2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日, 担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金 (LOF) 基金经理; 2018 年 6 月 15 日至今, 担任工银瑞信印度市场证券投资基金 (LOF) 基金经理; 2019 年 5 月 20 日至今, 担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2019 年 8 月 21 日至今, 担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理; 2019 年 10 月 17 日至 2022 年 3 月 21 日, 担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2019 年 11 月 1 日至 2022 年 3 月 21 日, 担任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基金经理; 2019 年 12 月 25 日至 2022 年 3 月 21 日, 担任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联接基金基金经理; 2020 年 6 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日, 担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 1 月 21 日至 2023 年 9 月 27 日, 担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 1 月 22 日至 2023 年 1 月 5 日, 担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 6 月 11 日至 2022 年 10 月 25 日, 担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 7 月 22 日至 2023 年 3 月 8 日, 担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理; 2021 年 8 月 5 日至今, 担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 11 月 26 日至 2023 年 1 月 5 日, 担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理; 2021 年 12 月 14 日至 2023 年 9 月 27 日, 担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经</p>
--	--	--	--	---

					理；2022 年 6 月 30 日至今，担任工银瑞信国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 7 月 4 日至今，担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2023 年 3 月 30 日至今，担任工银瑞信中证港股通高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 31 日至今，担任工银瑞信中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 11 月 9 日至今，担任工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员管理规则》的相关规定。

3、自 2024 年 8 月 14 日起，刘子豪担任本基金的基金经理。

#### 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 3 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年以来，国内宏观经济处在“经济底部震荡，政策维持呵护”的状态。经济在预期轨道上运行，市场整体呈现震荡格局。风格上，市场呈现“价值优于成长”的局面。一方面，A 股整体企业盈利周期下行，价值板块的盈利相对优势明显；另一方面，成长板块尤其是新能源、医药等权重方向，在过去几年积累了较为集中的筹码结构且估值不低，叠加地缘政治风险，在今年以来明显偏弱的资金面背景下表现不佳。

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

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成份股票的停牌；3) 指数成份股调整等。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 -18.06%，业绩比较基准收益率为 -19.67%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员（或委员会）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

###### （1）职责分工

估值委员会由主任委员、委员组成。

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

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

###### （2）专业胜任能力及相关工作经历

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

##### 2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可作为列席人员参会，有发言权，无表决权。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内（2023 年 12 月 1 日至 2024 年 1 月 25 日、2024 年 1 月 29 日至 2024 年 4 月 16 日、2024 年 4 月 18 日至 2024 年 6 月 28 日）出现连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的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：工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,101,783.90	830,896.90
结算备付金		123,724.20	1,858,747.64

存出保证金		23,129.68	59,234.30
交易性金融资产	6.4.7.2	13,110,301.08	15,169,640.65
其中：股票投资		13,110,301.08	15,169,640.65
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		14,434,347.98	17,918,519.49
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,723.66	11,799.23
应付托管费		734.79	1,835.42
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	71,875.62	383,769.21
负债合计		77,334.07	397,403.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	18,196,551.00	18,196,551.00
未分配利润	6.4.7.12	-3,839,537.09	-675,435.37
净资产合计		14,357,013.91	17,521,115.63
负债和净资产总计		14,434,347.98	17,918,519.49

注：1、本基金基金合同生效日为 2023 年 11 月 9 日。

2、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.7890 元，基金份额总额为 18,196,551.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,102,943.47
1. 利息收入		7,076.33
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,076.33
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,525,260.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,674,608.40
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	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	149,348.13
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	-445,227.68
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	-139,531.85
<b>减：二、营业总支出</b>		161,390.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	46,104.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,171.83
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	108,114.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,264,334.20
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,264,334.20
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-2,264,334.20

### 6.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	18,196,551.00	-675,435.37	17,521,115.63
二、本期期初净资产	18,196,551.00	-675,435.37	17,521,115.63
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-3,164,101.72	-3,164,101.72
(一)、综合收益总额	-	-2,264,334.20	-2,264,334.20
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-	-899,767.52	-899,767.52
其中：1. 基金申购款	132,000,000.00	-19,864,130.01	112,135,869.99
2. 基金赎回款	-132,000,000.00	18,964,362.49	-113,035,637.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	18,196,551.00	-3,839,537.09	14,357,013.91

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

工银瑞信国证 2000 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【2023】1313 号文,由工银瑞信基金管理有限公司

依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 11 月 09 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 218,196,551.00 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颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 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。本期财务报表的实际编制期间系 2024 年度和 2023 年 11 月 9 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止。

##### 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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

## 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券(如适用)起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资

产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债。未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及

基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

本基金投资金融资产（如涉及）参照以下原则确认和计量收入/损失：

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。

债券投资和资产支持证券投资（如适用）在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券（如适用）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投资收益。

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扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额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相关交易费用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。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

- （1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- （2）基金收益分配采用现金分红方式；
- （3）基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同

期累计报酬率；

(4) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；

(5) 基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 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，本基金确定以下类别金融资产（如涉及）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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处

理标准>的通知》之附件《关于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。

(4)对于基金投资,根据中基协发[2017]3号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》,采用如下方法估值:

(a)对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金,按所投资基金估值日的收盘价估值;

(b)对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金,按所投资基金估值日的份额净值估值;

(c)对于境内上市交易型货币市场基金,如所投资基金披露份额净值,则按所投资基金估值日的份额净值估值;如所投资基金披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益;

(d)对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况,本基金根据以下原则进行估值:

(a)以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值,按其最近公布的基金份额净值为基础估值;

(b)以所投资基金的收盘价估值的,若估值日无交易,且最近交易日后市场环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价,确定公允价值;

(c)如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]125号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,101,783.90
等于：本金	1,101,553.92
加：应计利息	229.98
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	1,101,783.90

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,088,325.25	-	13,110,301.08	-978,024.17
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	14,088,325.25	-	13,110,301.08	-978,024.17

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

#### 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

本基金本报告期末未持有期货投资。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	40,051.10
其中：交易所市场	40,051.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	21,880.04
IOPV 服务费	9,944.48
合计	71,875.62

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	18,196,551.00	18,196,551.00
本期申购	132,000,000.00	132,000,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-132,000,000.00	-132,000,000.00
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	18,196,551.00	18,196,551.00

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

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-648,391.51	-27,043.86	-675,435.37
本期期初	-648,391.51	-27,043.86	-675,435.37
本期利润	-1,819,106.52	-445,227.68	-2,264,334.20
本期基金份额交易产生的变动数	163,033.44	-1,062,800.96	-899,767.52
其中：基金申购款	-19,121,787.79	-742,342.22	-19,864,130.01
金赎回款	19,284,821.23	-320,458.74	18,964,362.49
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,304,464.59	-1,535,072.50	-3,839,537.09
-----	---------------	---------------	---------------

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		4,505.84
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		1,991.88
其他		578.61
合计		7,076.33

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-905,447.31
股票投资收益——赎回差价收入		-769,161.09
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		-1,674,608.40

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		69,207,163.97
减：卖出股票成本总额		69,969,808.22
减：交易费用		142,803.06
买卖股票差价收入		-905,447.31

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		113,035,637.51
减：现金支付赎回款总额		48,431,135.51
减：赎回股票成本总额		65,373,663.09
减：交易费用		-
赎回差价收入		-769,161.09

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	149,348.13
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	149,348.13

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-445,227.68
股票投资	-445,227.68
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	-445,227.68

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-139,531.85
合计	-139,531.85

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	21,880.04
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,298.73
IOPV 服务费	9,944.48
开户费	400.00
注册登记费	74,590.88
合计	108,114.13

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,104.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,325.45
应支付基金管理人的净管理费	43,779.32

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,171.83

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.07% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,101,783.90	4,505.84

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值 总额	备注
002308	威创股份	2024 年 5	重大事 项	0.00	2024 年 7 月	1.87	17,600	42,762.20	0.00	-

		月 6 日			9 日					
--	--	----------	--	--	-----	--	--	--	--	--

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下设的风险管理委员会、督察长、公司风险管理与内部控制委员会、法律合规部、风险管理部、稽核审计部以及各个业务部门组成。

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

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

(2) 风险管理部、法律合规部和各风险职能部门是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和

监督检查，负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告。

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

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,101,783.90	-	-	-	1,101,783.90
结算备付金	123,724.20	-	-	-	123,724.20
存出保证金	23,129.68	-	-	-	23,129.68
交易性金融资产	-	-	-	13,110,301.08	13,110,301.08
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	1,248,637.78	-	-	13,185,710.20	14,434,347.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,723.66	4,723.66
应付托管费	-	-	-	734.79	734.79
其他负债	-	-	-	71,875.62	71,875.62
负债总计	-	-	-	77,334.07	77,334.07
利率敏感度缺口	1,248,637.78	-	-	13,108,376.13	14,357,013.91
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	830,896.90	-	-	-	830,896.90
结算备付金	1,858,747.64	-	-	-	1,858,747.64
存出保证金	59,234.30	-	-	-	59,234.30
交易性金融资产	-	-	-	15,169,640.65	15,169,640.65
资产总计	2,748,878.84	-	-	15,169,640.65	17,918,519.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,799.23	11,799.23
应付托管费	-	-	-	1,835.42	1,835.42
其他负债	-	-	-	383,769.21	383,769.21
负债总计	-	-	-	397,403.86	397,403.86
利率敏感度缺口	2,748,878.84	-	-	14,772,236.79	17,521,115.63

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	13,110,301.08	91.32	15,169,640.65	86.58
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	13,110,301.08	91.32	15,169,640.65	86.58

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

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）	

分析	业绩比较基准增加 5%	675,373.50	733,713.89
	业绩比较基准减少 5%	-675,373.50	-733,713.89

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	13,110,301.08	15,169,640.65
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	13,110,301.08	15,169,640.65

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具账面价值与公允价值差异很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,110,301.08	90.83
	其中：股票	13,110,301.08	90.83
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	1,225,508.10	8.49
8	其他各项资产	98,538.80	0.68
9	合计	14,434,347.98	100.00

注：1、股票投资项含可退替代款估值增值。

2、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	131,698.00	0.92
B	采矿业	112,944.00	0.79
C	制造业	9,569,384.59	66.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	306,352.00	2.13

E	建筑业	149,643.00	1.04
F	批发和零售业	459,043.00	3.20
G	交通运输、仓储和邮政业	191,648.00	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,375,867.89	9.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	120,006.00	0.84
L	租赁和商务服务业	252,202.80	1.76
M	科学研究和技术服务业	187,775.80	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	115,791.00	0.81
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	119,633.00	0.83
S	综合	-	-
	合计	13,091,989.08	91.19

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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。

### 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	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,312.00	0.13
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	18,312.00	0.13

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。

### 7.2.3 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	300401	花园生物	5,800	83,172.00	0.58
2	300284	苏交科	9,700	78,376.00	0.55
3	688518	联赢激光	4,588	76,619.60	0.53
4	603393	新天然气	2,200	76,428.00	0.53
5	603300	华铁应急	13,600	74,256.00	0.52
6	600761	安徽合力	3,400	73,576.00	0.51
7	301129	瑞纳智能	2,900	73,196.00	0.51
8	605090	九丰能源	2,500	72,500.00	0.50
9	600728	佳都科技	18,700	69,377.00	0.48
10	002322	理工能科	4,300	68,886.00	0.48
11	002073	软控股份	9,300	68,727.00	0.48
12	002332	仙琚制药	6,000	68,460.00	0.48
13	600312	平高电气	3,500	68,075.00	0.47
14	002139	拓邦股份	6,400	67,968.00	0.47
15	600587	新华医疗	4,300	67,682.00	0.47
16	002296	辉煌科技	6,500	67,015.00	0.47
17	300170	汉得信息	10,900	66,926.00	0.47
18	000036	华联控股	20,500	66,420.00	0.46
19	002635	安洁科技	4,300	66,392.00	0.46
20	002020	京新药业	6,300	65,961.00	0.46
21	600586	金晶科技	11,300	65,540.00	0.46
22	601208	东材科技	9,000	65,340.00	0.46

23	002015	协鑫能科	8,200	65,272.00	0.45
24	002102	能特科技	28,000	65,240.00	0.45
25	002171	楚江新材	9,800	64,582.00	0.45
26	002649	博彦科技	8,100	64,476.00	0.45
27	601137	博威合金	4,200	64,008.00	0.45
28	600480	凌云股份	6,500	63,895.00	0.45
29	002170	芭田股份	10,600	63,706.00	0.44
30	002038	双鹭药业	8,600	63,382.00	0.44
31	002449	国星光电	8,900	63,368.00	0.44
32	600252	中恒集团	29,200	63,364.00	0.44
33	002761	浙江建投	8,100	63,261.00	0.44
34	000612	焦作万方	9,700	63,050.00	0.44
35	600458	时代新材	6,200	62,620.00	0.44
36	600108	亚盛集团	26,400	62,568.00	0.44
37	002154	报喜鸟	11,500	62,560.00	0.44
38	603118	共进股份	9,300	62,310.00	0.43
39	300035	中科电气	7,300	62,123.00	0.43
40	600531	豫光金铅	9,600	61,824.00	0.43
41	300409	道氏技术	7,200	61,632.00	0.43
42	002627	三峡旅游	12,700	61,341.00	0.43
43	600664	哈药股份	23,200	61,248.00	0.43
44	002869	金溢科技	1,900	61,199.00	0.43
45	002929	润建股份	2,100	61,131.00	0.43
46	002254	泰和新材	6,900	61,065.00	0.43
47	301071	力量钻石	2,200	60,962.00	0.42
48	300138	晨光生物	7,200	60,696.00	0.42
49	600477	杭萧钢构	25,900	60,347.00	0.42
50	300420	五洋自控	27,500	60,225.00	0.42
51	002057	中钢天源	8,600	60,200.00	0.42
52	002697	红旗连锁	13,000	60,190.00	0.42
53	300770	新媒股份	1,800	60,084.00	0.42
54	300119	瑞普生物	4,400	59,928.00	0.42
55	002204	大连重工	14,000	59,780.00	0.42
56	000973	佛塑科技	16,200	59,778.00	0.42
57	300976	达瑞电子	1,300	59,605.00	0.42
58	300041	回天新材	7,500	59,550.00	0.41
59	002960	青鸟消防	4,700	59,408.00	0.41
60	301150	中一科技	3,300	59,301.00	0.41
61	002454	松芝股份	10,600	59,254.00	0.41
62	300398	飞凯材料	4,800	59,040.00	0.41
63	300232	洲明科技	11,300	58,986.00	0.41
63	600479	千金药业	5,800	58,986.00	0.41
64	300393	中来股份	10,200	58,854.00	0.41

65	300513	恒实科技	7,200	58,680.00	0.41
66	000755	山西高速	14,000	58,520.00	0.41
67	002955	鸿合科技	2,500	58,450.00	0.41
68	601515	东峰集团	16,000	58,400.00	0.41
69	605286	同力日升	2,400	58,392.00	0.41
70	600300	维维股份	24,300	58,320.00	0.41
71	002293	罗莱生活	7,200	58,176.00	0.41
72	600729	重庆百货	2,600	58,136.00	0.40
73	605377	华旺科技	4,380	58,035.00	0.40
74	002130	沃尔核材	4,100	57,892.00	0.40
75	300095	华伍股份	10,500	57,855.00	0.40
76	300360	炬华科技	3,400	57,800.00	0.40
77	603801	志邦家居	4,400	57,552.00	0.40
78	601579	会稽山	5,600	57,344.00	0.40
79	688553	汇宇制药	4,615	57,318.30	0.40
80	300193	佳士科技	7,700	57,134.00	0.40
81	002554	惠博普	26,200	56,854.00	0.40
82	000936	华西股份	9,900	56,628.00	0.39
83	600103	青山纸业	33,100	56,601.00	0.39
84	600229	城市传媒	8,200	56,498.00	0.39
85	001223	欧克科技	1,600	56,304.00	0.39
86	300007	汉威科技	4,100	56,252.00	0.39
87	002829	星网宇达	4,200	56,238.00	0.39
88	001301	尚太科技	1,300	56,186.00	0.39
89	605123	派克新材	1,000	56,180.00	0.39
90	603618	杭电股份	12,800	56,064.00	0.39
91	000557	西部创业	14,900	56,024.00	0.39
92	002658	雪迪龙	10,900	55,917.00	0.39
93	000551	创元科技	6,400	55,872.00	0.39
94	600230	沧州大化	5,500	55,715.00	0.39
95	000919	金陵药业	8,900	55,714.00	0.39
96	603126	中材节能	10,200	55,590.00	0.39
97	002035	华帝股份	8,900	55,447.00	0.39
98	002757	南兴股份	4,600	55,430.00	0.39
99	603610	麒盛科技	5,600	55,328.00	0.39
100	600846	同济科技	8,100	55,323.00	0.39
101	002669	康达新材	6,700	55,141.00	0.38
102	603109	神驰机电	4,200	55,062.00	0.38
103	600572	康恩贝	12,300	54,981.00	0.38
104	603966	法兰泰克	8,000	54,960.00	0.38
105	002860	星帅尔	6,700	54,873.00	0.38
106	605208	永茂泰	8,800	54,824.00	0.38
107	600336	澳柯玛	12,800	54,784.00	0.38

108	605136	丽人丽妆	9,900	54,549.00	0.38
109	603359	东珠生态	15,000	54,450.00	0.38
110	603890	春秋电子	6,000	54,360.00	0.38
111	000915	华特达因	1,800	54,288.00	0.38
111	601968	宝钢包装	11,600	54,288.00	0.38
112	600814	杭州解百	9,200	54,280.00	0.38
113	605168	三人行	2,060	54,239.80	0.38
114	300435	中泰股份	4,600	54,142.00	0.38
115	002330	得利斯	14,800	54,020.00	0.38
116	300158	振东制药	14,100	53,862.00	0.38
117	688133	泰坦科技	3,410	53,809.80	0.37
118	603187	海容冷链	4,600	53,636.00	0.37
119	600577	精达股份	13,500	53,595.00	0.37
120	000631	顺发恒业	22,900	53,586.00	0.37
121	600419	天润乳业	6,700	53,399.00	0.37
122	002221	东华能源	6,400	52,544.00	0.37
123	300241	瑞丰光电	12,800	52,480.00	0.37
124	600389	江山股份	3,700	52,207.00	0.36
125	603527	众源新材	7,300	51,830.00	0.36
126	300185	通裕重工	30,100	51,772.00	0.36
127	603901	永创智能	7,300	51,757.00	0.36
128	000422	湖北宜化	4,300	51,256.00	0.36
129	002181	粤传媒	15,800	51,034.00	0.36
130	000700	模塑科技	9,700	50,925.00	0.35
131	002126	银轮股份	2,900	50,489.00	0.35
132	600789	鲁抗医药	7,200	50,400.00	0.35
133	002546	新联电子	15,300	49,725.00	0.35
134	600986	浙文互联	11,800	49,560.00	0.35
135	688308	欧科亿	2,524	49,016.08	0.34
136	603690	至纯科技	2,100	48,321.00	0.34
137	688388	嘉元科技	4,934	48,106.50	0.34
138	300986	志特新材	7,100	48,067.00	0.33
139	605366	宏柏新材	8,000	46,480.00	0.32
140	603601	再升科技	16,800	46,368.00	0.32
141	002218	拓日新能	16,200	46,170.00	0.32
142	000913	钱江摩托	2,900	45,704.00	0.32
143	002239	奥特佳	19,500	44,850.00	0.31
144	002851	麦格米特	1,700	43,928.00	0.31
145	300083	创世纪	7,100	43,523.00	0.30
146	603308	应流股份	3,500	43,470.00	0.30
147	002458	益生股份	5,000	43,300.00	0.30
148	300130	新国都	2,600	43,264.00	0.30
149	300184	力源信息	9,300	43,059.00	0.30

150	600106	重庆路桥	10,000	43,000.00	0.30
151	603353	和顺石油	3,300	42,768.00	0.30
152	002215	诺普信	5,600	41,720.00	0.29
152	688676	金盘科技	800	41,720.00	0.29
153	600285	羚锐制药	1,700	41,157.00	0.29
154	000766	通化金马	2,500	40,475.00	0.28
155	002270	华明装备	1,800	40,032.00	0.28
156	600366	宁波韵升	7,600	39,672.00	0.28
157	688608	恒玄科技	269	39,376.22	0.27
158	300109	新开源	3,400	39,372.00	0.27
159	300133	华策影视	6,400	39,296.00	0.27
160	002182	宝武镁业	3,460	39,028.80	0.27
161	002832	比音勒芬	1,600	38,672.00	0.27
162	688596	正帆科技	1,152	38,016.00	0.26
163	600452	涪陵电力	3,000	38,010.00	0.26
164	002446	盛路通信	6,700	37,855.00	0.26
165	300181	佐力药业	2,500	37,800.00	0.26
165	600601	方正科技	12,600	37,800.00	0.26
166	600557	康缘药业	2,400	37,680.00	0.26
167	000811	冰轮环境	3,900	37,635.00	0.26
168	002011	盾安环境	3,800	37,354.00	0.26
169	600750	江中药业	1,600	36,976.00	0.26
170	300075	数字政通	2,500	36,875.00	0.26
171	002400	省广集团	7,600	36,860.00	0.26
172	300315	掌趣科技	8,800	36,696.00	0.26
173	300679	电连技术	900	36,207.00	0.25
174	600850	电科数字	2,000	36,200.00	0.25
175	002063	远光软件	6,900	36,156.00	0.25
176	300638	广和通	2,100	35,910.00	0.25
177	300627	华测导航	1,200	35,820.00	0.25
178	000676	智度股份	5,900	35,813.00	0.25
179	600363	联创光电	1,300	35,776.00	0.25
180	600422	昆药集团	2,000	35,660.00	0.25
181	002675	东诚药业	2,900	35,554.00	0.25
182	300451	创业慧康	10,200	35,292.00	0.25
183	300049	福瑞股份	700	35,238.00	0.25
184	300745	欣锐科技	2,400	34,704.00	0.24
185	688076	诺泰生物	442	34,599.76	0.24
186	002276	万马股份	4,800	34,416.00	0.24
187	002261	拓维信息	3,100	34,317.00	0.24
188	000099	中信海直	2,100	34,104.00	0.24
189	600201	生物股份	4,700	33,887.00	0.24
190	002003	伟星股份	2,700	33,885.00	0.24

191	301050	雷电微力	700	33,712.00	0.23
192	000829	天音控股	3,700	33,596.00	0.23
193	603108	润达医疗	2,200	33,308.00	0.23
194	300674	宇信科技	3,000	33,240.00	0.23
195	688019	安集科技	262	32,959.60	0.23
196	300593	新雷能	3,300	32,802.00	0.23
197	600446	金证股份	3,300	32,769.00	0.23
198	688568	中科星图	685	32,674.50	0.23
199	688208	道通科技	1,350	32,589.00	0.23
200	300762	上海瀚讯	1,800	32,238.00	0.22
201	002222	福晶科技	1,430	32,217.90	0.22
202	603063	禾望电气	2,100	32,193.00	0.22
203	300525	博思软件	2,500	31,750.00	0.22
204	300456	赛微电子	2,000	31,740.00	0.22
205	002079	苏州固锟	3,700	31,524.00	0.22
206	688166	博瑞医药	896	31,360.00	0.22
207	300236	上海新阳	1,000	31,140.00	0.22
208	000628	高新发展	700	31,059.00	0.22
209	601126	四方股份	1,600	30,752.00	0.21
210	002698	博实股份	2,500	30,675.00	0.21
211	603283	赛腾股份	400	30,560.00	0.21
212	603279	景津装备	1,400	30,366.00	0.21
213	600114	东睦股份	2,100	30,219.00	0.21
214	600602	云赛智联	2,700	29,808.00	0.21
215	300036	超图软件	2,100	29,316.00	0.20
216	688575	亚辉龙	1,246	29,056.72	0.20
217	603083	剑桥科技	900	29,052.00	0.20
218	001696	宗申动力	2,700	28,728.00	0.20
219	002837	英维克	1,340	28,662.60	0.20
220	002317	众生药业	2,500	28,575.00	0.20
221	300857	协创数据	500	28,500.00	0.20
222	603197	保隆科技	900	28,350.00	0.20
223	600552	凯盛科技	3,000	28,290.00	0.20
224	688235	百济神州	244	28,264.96	0.20
225	688116	天奈科技	1,224	28,249.92	0.20
226	300229	拓尔思	2,100	28,203.00	0.20
227	601020	华钰矿业	2,200	28,160.00	0.20
228	603505	金石资源	1,000	27,930.00	0.19
229	600877	电科芯片	2,600	27,872.00	0.19
230	000681	视觉中国	2,400	27,600.00	0.19
230	000682	东方电子	2,500	27,600.00	0.19
231	002335	科华数据	1,300	27,469.00	0.19
232	000657	中钨高新	3,000	27,420.00	0.19

233	300738	奥飞数据	2,700	27,324.00	0.19
234	600331	宏达股份	4,700	27,213.00	0.19
235	688327	云从科技	2,404	27,189.24	0.19
236	000420	吉林化纤	8,600	27,176.00	0.19
237	600537	亿晶光电	10,600	26,712.00	0.19
238	600993	马应龙	1,000	26,670.00	0.19
239	300475	香农芯创	900	26,613.00	0.19
240	300101	振芯科技	1,800	26,586.00	0.19
241	600771	广誉远	1,400	26,362.00	0.18
242	002544	普天科技	1,400	26,166.00	0.18
243	688088	虹软科技	903	26,060.58	0.18
244	001309	德明利	300	25,920.00	0.18
245	603477	巨星农牧	900	25,830.00	0.18
246	300166	东方国信	4,200	25,704.00	0.18
247	002100	天康生物	3,700	25,641.00	0.18
248	603997	继峰股份	2,500	25,575.00	0.18
249	300655	晶瑞电材	3,500	25,200.00	0.18
250	688408	中信博	273	25,137.84	0.18
251	300705	九典制药	940	25,135.60	0.18
252	688639	华恒生物	324	24,750.36	0.17
253	300045	华力创通	1,400	24,710.00	0.17
254	300811	铂科新材	560	24,584.00	0.17
255	603220	中贝通信	900	24,444.00	0.17
256	300779	惠城环保	500	24,200.00	0.17
257	300199	翰宇药业	2,200	23,870.00	0.17
258	300678	中科信息	900	23,868.00	0.17
259	600158	中体产业	3,100	23,839.00	0.17
260	600199	金种子酒	2,000	23,820.00	0.17
261	688029	南微医学	384	23,639.04	0.16
262	300188	国投智能	2,100	23,331.00	0.16
263	002292	奥飞娱乐	3,900	23,322.00	0.16
264	002036	联创电子	3,400	22,950.00	0.16
265	688007	光峰科技	1,405	22,620.50	0.16
266	002567	唐人神	4,200	22,512.00	0.16
267	688266	泽璟制药	413	22,392.86	0.16
268	300624	万兴科技	419	22,236.33	0.15
269	603496	恒为科技	900	22,005.00	0.15
270	000801	四川九洲	2,200	22,000.00	0.15
271	600186	莲花控股	6,400	21,952.00	0.15
272	688083	中望软件	302	21,931.24	0.15
273	688789	宏华数科	200	21,560.00	0.15
274	688333	铂力特	443	21,463.35	0.15
275	688110	东芯股份	1,110	21,167.70	0.15

276	300855	图南股份	800	21,152.00	0.15
277	002326	永太科技	2,700	21,114.00	0.15
278	300693	盛弘股份	1,000	20,940.00	0.15
279	300151	昌红科技	1,300	20,566.00	0.14
280	300168	万达信息	4,300	20,425.00	0.14
281	300327	中颖电子	1,000	19,680.00	0.14
282	300657	弘信电子	1,300	19,526.00	0.14
283	688766	普冉股份	200	19,434.00	0.14
284	300379	东方通	2,400	19,392.00	0.14
285	300576	容大感光	500	18,265.00	0.13
286	300053	航宇微	2,000	18,220.00	0.13
287	300685	艾德生物	1,000	17,640.00	0.12
288	688409	富创精密	477	17,620.38	0.12
289	000503	国新健康	2,600	17,342.00	0.12
290	002840	华统股份	1,000	16,590.00	0.12
291	688321	微芯生物	800	14,080.00	0.10
292	688630	芯碁微装	200	12,514.00	0.09
293	688062	迈威生物	400	11,576.00	0.08
294	300757	罗博特科	100	8,735.00	0.06
295	688798	艾为电子	100	5,662.00	0.04

### 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	000034	神州数码	800	18,312.00	0.13
2	002308	威创股份	17,600	0.00	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	603393	新天然气	646,533.00	3.69
2	601137	博威合金	602,757.00	3.44
3	600635	大众公用	599,706.00	3.42
4	601515	东峰集团	589,968.00	3.37
5	600846	同济科技	586,704.00	3.35
6	603187	海容冷链	581,524.20	3.32
7	600586	金晶科技	575,178.00	3.28
8	603610	麒盛科技	572,063.00	3.26
9	600300	维维股份	571,837.00	3.26
10	688308	欧科亿	571,070.50	3.26
11	605377	华旺科技	565,180.00	3.23
12	600477	杭萧钢构	564,232.00	3.22

13	600252	中恒集团	563,854.00	3.22
14	600108	亚盛集团	558,490.00	3.19
15	603300	华铁应急	557,841.00	3.18
16	600675	中华企业	556,204.00	3.17
17	600691	阳煤化工	555,940.00	3.17
18	603118	共进股份	553,337.00	3.16
19	600336	澳柯玛	549,865.00	3.14
20	600251	冠农股份	549,171.00	3.13
21	600577	精达股份	544,039.00	3.11
22	600103	青山纸业	543,409.00	3.10
23	603727	博迈科	540,954.00	3.09
24	600419	天润乳业	539,689.00	3.08
25	603181	皇马科技	538,950.00	3.08
26	600479	千金药业	535,227.00	3.05
27	600458	时代新材	532,662.00	3.04
28	688121	卓然股份	532,591.60	3.04
29	601579	会稽山	532,151.00	3.04
30	600814	杭州解百	530,056.00	3.03
31	603583	捷昌驱动	516,338.00	2.95
32	600664	哈药股份	514,172.00	2.93
33	600590	泰豪科技	513,186.00	2.93
34	603979	金诚信	512,813.00	2.93
35	603618	杭电股份	509,417.00	2.91
36	603109	神驰机电	508,701.00	2.90
37	603808	歌力思	489,204.00	2.79
38	688553	汇宇制药	487,873.36	2.78
39	600106	重庆路桥	485,129.00	2.77
40	600172	黄河旋风	482,144.00	2.75
41	600761	安徽合力	480,771.00	2.74
42	605090	九丰能源	479,788.40	2.74
43	600789	鲁抗医药	479,058.10	2.73
44	600366	宁波韵升	474,844.00	2.71
45	605168	三人行	471,287.00	2.69
46	603890	春秋电子	465,671.00	2.66
47	600587	新华医疗	463,832.00	2.65
48	600312	平高电气	463,576.00	2.65
49	600572	康恩贝	452,848.00	2.58
50	688019	安集科技	419,718.48	2.40
51	601208	东材科技	415,532.00	2.37
52	600557	康缘药业	414,009.00	2.36
53	688235	百济神州	412,811.08	2.36
54	688556	高测股份	408,246.88	2.33
55	603938	三孚股份	406,306.00	2.32

56	603690	至纯科技	403,531.00	2.30
57	688388	嘉元科技	389,281.92	2.22
58	600422	昆药集团	387,497.00	2.21
59	603619	中曼石油	383,289.00	2.19
60	600452	涪陵电力	371,602.00	2.12
61	688608	恒玄科技	363,564.32	2.08
62	600133	东湖高新	357,543.00	2.04
63	605208	永茂泰	354,171.00	2.02
64	600201	生物股份	353,319.00	2.02

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	600635	大众公用	645,292.00	3.68
2	603393	新天然气	626,180.00	3.57
3	603727	博迈科	604,630.00	3.45
4	601137	博威合金	595,304.00	3.40
5	600251	冠农股份	581,390.94	3.32
6	603979	金诚信	573,028.00	3.27
7	605377	华旺科技	564,716.00	3.22
8	600846	同济科技	561,593.00	3.21
9	601515	东峰集团	556,593.00	3.18
10	600586	金晶科技	555,681.00	3.17
11	603181	皇马科技	553,085.00	3.16
12	603187	海容冷链	549,444.00	3.14
13	600252	中恒集团	545,893.00	3.12
14	688308	欧科亿	543,577.35	3.10
15	600675	中华企业	540,522.00	3.08
16	600691	阳煤化工	539,930.00	3.08
17	600577	精达股份	533,881.00	3.05
18	600108	亚盛集团	532,408.00	3.04
19	603610	麒盛科技	531,833.00	3.04
20	603300	华铁应急	529,504.00	3.02
21	600477	杭萧钢构	527,193.00	3.01
22	600458	时代新材	526,278.00	3.00
23	601579	会稽山	525,842.00	3.00
24	600479	千金药业	521,356.00	2.98
25	600789	鲁抗医药	520,122.00	2.97
26	603583	捷昌驱动	518,483.00	2.96
27	600300	维维股份	514,003.00	2.93

28	603118	共进股份	510,171.00	2.91
29	600103	青山纸业	508,377.00	2.90
30	600814	杭州解百	508,268.00	2.90
31	603808	歌力思	505,095.00	2.88
32	688121	卓然股份	501,828.17	2.86
33	600761	安徽合力	498,385.00	2.84
34	600419	天润乳业	497,519.00	2.84
35	600590	泰豪科技	495,271.60	2.83
36	600172	黄河旋风	485,166.00	2.77
37	600336	澳柯玛	482,097.00	2.75
38	603109	神驰机电	479,441.00	2.74
39	688553	汇宇制药	473,336.40	2.70
40	600106	重庆路桥	468,416.00	2.67
41	600366	宁波韵升	459,071.00	2.62
42	600312	平高电气	455,357.00	2.60
43	603619	中曼石油	455,039.00	2.60
44	600664	哈药股份	454,138.00	2.59
45	600587	新华医疗	453,950.00	2.59
46	605090	九丰能源	447,199.00	2.55
47	603618	杭电股份	445,502.00	2.54
48	603890	春秋电子	440,455.00	2.51
49	600572	康恩贝	433,936.00	2.48
50	603938	三孚股份	430,403.00	2.46
51	688019	安集科技	419,210.85	2.39
52	688235	百济神州	405,637.17	2.32
53	688556	高测股份	401,552.01	2.29
54	600422	昆药集团	385,860.00	2.20
55	605168	三人行	379,155.00	2.16
56	600133	东湖高新	378,878.00	2.16
57	603690	至纯科技	377,982.00	2.16
58	600557	康缘药业	377,697.00	2.16
59	688608	恒玄科技	375,000.84	2.14
60	600452	涪陵电力	373,961.00	2.13
61	601226	华电重工	373,772.00	2.13
62	688550	瑞联新材	367,968.89	2.10
63	688388	嘉元科技	354,107.61	2.02
64	601208	东材科技	353,630.00	2.02
65	600201	生物股份	352,158.00	2.01
66	601900	南方传媒	350,904.00	2.00

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	70,493,243.42
卖出股票收入（成交）总额	69,207,163.97

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，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 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中，宁波理工环境能源科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局、深交所的处罚，苏教科集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局、深交所的处罚。

本基金对上述股票的投资属于跟踪标的指数的被动投资，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

### 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	23,129.68
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	75,409.12
8	其他	-
9	合计	98,538.80

### 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

#### 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	002308	威创股份	0.00	0.00	重大事项停牌

### 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

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 (%)
388	46,898.33	4,641,266.00	25.51	13,555,285.00	74.49

## 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	刘慧	8,618,072.00	47.36
2	招商证券股份有限公司	2,698,065.00	14.83
3	中国银河证券股份有限公司	1,402,879.00	7.71
4	梁健	1,000,126.00	5.50
5	中信建投证券股份有限公司	528,921.00	2.91
6	张静堂	470,000.00	2.58
7	林可芬	300,064.00	1.65
8	徐金蟾	200,029.00	1.10
9	吴局欢	200,023.00	1.10
10	张嫣雯	200,000.00	1.10

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年11月9日） 基金份额总额	218,196,551.00
本报告期期初基金份额总额	18,196,551.00
本报告期基金总申购份额	132,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	132,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,196,551.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

### 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 (%)	
招商证券	2	94,951,728.90	67.97	69,873.22	70.41	-
华创证券	1	18,025,535.87	12.90	11,462.83	11.55	-
国泰君安	1	17,648,980.97	12.63	11,221.79	11.31	-
华西证券	2	6,860,502.30	4.91	5,048.84	5.09	-
中金公司	2	2,213,659.35	1.58	1,629.12	1.64	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准

- a) 财务状况良好。
- b) 经营行为规范。
- c) 合规记录优良。

(2) 选择程序

根据以上标准, 基金管理人将对证券公司进行考察、选择和确定。根据对其评估结果, 决定是否作为新增合作证券公司。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 在合同存续期间, 基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

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

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

租用其交易单元。

表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

### 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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
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工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 1 月 13 日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 1 月 23 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 2 月 6 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京中期时代销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 2 月 29 日
5	关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 3 月 15 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于	中国证监会规定的媒介	2024 年 3 月 19 日

	5000 万元的提示性公告		
7	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 4 月 2 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 4 月 11 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 6 月 4 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 6 月 19 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 6 月 26 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240102-20240103, 20240110-20240124, 20240229-20240317, 20240320-20240321, 20240408-20240410, 20240514-20240616	3,448,074.00	95,617,549.00	96,367,558.00	2,698,065.00	14.83
	2	20240108-20240109	-	8,709,600.00	8,709,600.00	-	-
	3	20240125-20240125, 20240202-20240204,	3,145,272.00	106,705,248.00	109,321,599.00	528,921.00	2.91

		20240229-20240304, 20240315-20240319, 20240322-20240324, 20240329-20240401					
	4	20240126-20240128	-	23,177,100.00	23,177,100.00	-	-
	5	20240126-20240128	-	20,861,100.00	20,861,100.00	-	-
	6	20240226-20240228	-	9,924,600.00	9,924,600.00	-	-
	7	20240417-20240513	-	35,947,800.00	35,947,800.00	-	-
个人	1	20240101-20240107, 20240110-20240125, 20240129-20240225, 20240229-20240416, 20240514-20240514, 20240617-20240630	5,000,972.00	10,817,200.00	7,200,100.00	8,618,072.00	47.36
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中, 存在基金规模大幅波动的风险, 以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

注：1、期初份额为上期期末或基金合同公告生效日当天份额。

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

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数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](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2024年8月30日