

工银瑞信中证 500 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

§ 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
3.3 其他指标	7
§ 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	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
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
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	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
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	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银中证 500ETF
场内简称	工银 500、工银中证 500ETF
基金主代码	510530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 17 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	46,479,379.00 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	2020 年 1 月 3 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	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。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%。
业绩比较基准	中证 500 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，主要采用完全复制策略，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	许俊
	联系电话	400-811-9999	010-66596688
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	赵桂才	葛海蛟

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.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	-7,434,265.27
本期利润	-19,128,263.97
加权平均基金份额本期利润	-0.4211
本期加权平均净值利润率	-7.73%
本期基金份额净值增长率	-8.07%
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	408,165.68
期末可供分配基金份额利润	0.0088
期末基金资产净值	240,827,745.22
期末基金份额净值	5.1814
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	0.17%

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

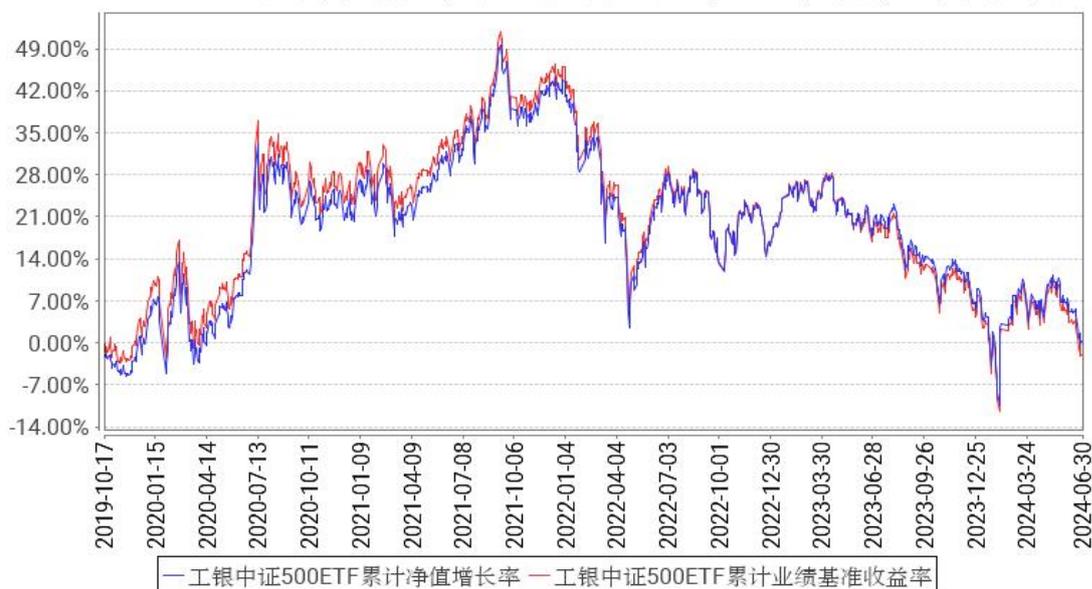
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-6.23%	0.95%	-6.89%	0.96%	0.66%	-0.01%
过去三个月	-5.41%	1.13%	-6.50%	1.14%	1.09%	-0.01%
过去六个月	-8.07%	1.58%	-8.96%	1.61%	0.89%	-0.03%
过去一年	-16.65%	1.26%	-17.60%	1.27%	0.95%	-0.01%
过去三年	-24.63%	1.18%	-27.40%	1.20%	2.77%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.17%	1.25%	-1.90%	1.27%	2.07%	-0.02%

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

工银中证500ETF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 2019 年 10 月 17 日生效。

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

3.3 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		
赵栩	指数及量化投资部副总经理、本基金的基金经理	2019年10月17日	-	16年	硕士研究生。2008年加入工银瑞信，曾任风险管理部金融工程分析师；现任指数及量化投资部副总经理、基金经理。2011年10月18日至今，担任上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2012年10月9日至今，担任深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2012年10月9日至今，担任工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2013年5月28日至2017年6月19日，担任工银瑞信国际原油证券投资基

				<p>金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 27 日，担任工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，担任工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金经理；2017 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2018 年 12 月 7 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信上证 50 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 日至今，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 12 月 19 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 18 日至今，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；2020 年 4 月 24 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金基金经理；2020 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式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；2020 年 7 月 24 日至 2022 年 4 月 26 日，担任工银瑞信深证 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 9 月 28 日至今，担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 5 日至今，担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2021 年 6 月 18 日至 2023 年 2 月 27 日，担任工银瑞信深证物联网 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；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 13 日至今，担任工银瑞信中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 4 月 27 日至今，担任工</p>
--	--	--	--	---

					银瑞信北证 50 成份指数证券投资基金基金经理；2023 年 6 月 27 日至 2024 年 3 月 8 日，担任工银瑞信中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2024 年 3 月 6 日至今，担任工银瑞信中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2024 年 5 月 28 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发起式联接基金基金经理；2024 年 6 月 4 日至今，担任工银瑞信中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所

公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 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 -8.07%，业绩比较基准收益率为 -8.96%。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：工银瑞信中证 500 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	2,354,186.55	2,934,680.06
结算备付金		23,755.17	154,647.08
存出保证金		36,980.42	32,730.19
交易性金融资产	6.4.7.2	238,701,649.92	242,436,189.52

其中：股票投资		238,701,649.92	242,436,189.52
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	-	-
资产总计		241,116,572.06	245,558,246.85
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.55	0.44
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		92,960.09	93,463.64
应付托管费		14,460.48	14,538.80
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	181,405.72	397,011.27
负债合计		288,826.84	505,014.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	240,419,579.54	224,901,757.35
未分配利润	6.4.7.12	408,165.68	20,151,475.35
净资产合计		240,827,745.22	245,053,232.70
负债和净资产总计		241,116,572.06	245,558,246.85

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日。

2、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 5.1814 元，基金份额总额为 46,479,379.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 500 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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-18,316,006.15	10,062,104.84
1. 利息收入		6,658.10	6,964.84
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,658.10	6,964.84
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）		-6,898,863.26	-5,324,381.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,271,621.52	-8,601,868.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	174,331.48
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	3,372,758.26	3,103,155.00
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	-11,693,998.70	15,226,513.34
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	270,197.71	153,008.58
减：二、营业总支出		812,257.82	916,001.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	554,838.54	614,372.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,308.24	95,568.99
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		-	0.11

8. 其他费用	6.4.7.23	171,111.04	206,059.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,128,263.97	9,146,103.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,128,263.97	9,146,103.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,128,263.97	9,146,103.71

6.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信中证 500 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	224,901,757.35	20,151,475.35	245,053,232.70
二、本期期初净资产	224,901,757.35	20,151,475.35	245,053,232.70
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	15,517,822.19	-19,743,309.67	-4,225,487.48
（一）、综合收益总额	-	-19,128,263.97	-19,128,263.97
（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）	15,517,822.19	-615,045.70	14,902,776.49
其中：1. 基金申购款	51,726,073.97	413,910.57	52,139,984.54
2. 基金赎回款	-36,208,251.78	-1,028,956.27	-37,237,208.05
（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	240,419,579.54	408,165.68	240,827,745.22
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	237,833,275.87	38,905,468.18	276,738,744.05
二、本期期初净资产	237,833,275.87	38,905,468.18	276,738,744.05
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-20,690,429.60	4,919,236.54	-15,771,193.06
(一)、综合收益总额	-	9,146,103.71	9,146,103.71
(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)	-20,690,429.60	-4,226,867.17	-24,917,296.77
其中：1. 基金申购款	25,863,036.98	6,269,055.63	32,132,092.61
2. 基金赎回款	-46,553,466.58	-10,495,922.80	-57,049,389.38
(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	217,142,846.27	43,824,704.72	260,967,550.99

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

郝焱

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

工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]220 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《工银瑞信中证 500 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,《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,080,968,281.00 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 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	2,354,186.55
等于：本金	2,353,962.74
加：应计利息	223.81
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	2,354,186.55

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	278,140,104.09	-	238,701,649.92	-39,438,454.17
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	278,140,104.09	-	238,701,649.92	-39,438,454.17
----	----------------	---	----------------	----------------

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

无。

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	47,402.52
其中：交易所市场	47,402.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	59,672.34
指数使用费	35,000.00
IOPV 服务费	14,467.84
合计	181,405.72

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	43,479,379.00	224,901,757.35
本期申购	10,000,000.00	51,726,073.97
本期赎回（以“-”号填列）	-7,000,000.00	-36,208,251.78
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	46,479,379.00	240,419,579.54

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,670,237.25	-60,518,761.90	20,151,475.35
本期期初	80,670,237.25	-60,518,761.90	20,151,475.35
本期利润	-7,434,265.27	-11,693,998.70	-19,128,263.97
本期基金份额交易产生的变动数	5,254,738.25	-5,869,783.95	-615,045.70
其中：基金申购款	17,701,388.94	-17,287,478.37	413,910.57
基金赎回款	-12,446,650.69	11,417,694.42	-1,028,956.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,490,710.23	-78,082,544.55	408,165.68

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	5,144.76
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	1,146.20
其他	367.14
合计	6,658.10

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	-7,830,977.44
股票投资收益——赎回差价收入	-2,440,644.08
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	-10,271,621.52
----	----------------

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	47,925,195.37
减：卖出股票成本总额	55,655,368.19
减：交易费用	100,804.62
买卖股票差价收入	-7,830,977.44

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	37,237,208.05
减：现金支付赎回款总额	19,316,962.05
减：赎回股票成本总额	20,360,890.08
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,440,644.08

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	3,372,758.26
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	3,372,758.26

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	-11,693,998.70
股票投资	-11,693,998.70
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	-11,693,998.70

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	270,197.71
合计	270,197.71

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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	2,022.40
存托服务费	85.44
IOPV 服务费	14,467.84

合计	171,111.04
----	------------

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
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	基金管理人管理的其他基金

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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	554,838.54	614,372.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,764.10	7,859.87
应支付基金管理人的净管理费	548,074.44	606,512.71

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	86,308.24	95,568.99

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

基金托管费每日计提，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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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（%）
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	11,472,600.00	24.68	10,890,600.00	25.05

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		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国银行股份有限公司	2,354,186.55	5,144.76	4,322,424.34	5,930.89

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

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
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,138	21,223.70	21,223.70	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	204	3,555.72	7,050.24	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.96	322	5,216.40	5,139.12	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定	26.00	37.49	132	3,432.00	4,948.68	-
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	158	2,747.62	3,254.80	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	136	2,608.48	3,081.76	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	101	2,149.28	2,978.49	-
603381	永臻	2024年6月	6个月	新股锁定	23.35	25.13	112	2,615.20	2,814.56	-

	股份	19 日								
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	37	2,681.02	2,518.22	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁定	38.18	38.90	61	2,328.98	2,372.90	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	18.65	18.65	127	2,368.55	2,368.55	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定	16.98	13.48	164	2,784.72	2,210.72	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	29.02	25.36	86	2,495.72	2,180.96	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	重大事项	0.00	-	-	202,200	517,907.01	0.00	-

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	2,354,186.55	-	-	-	2,354,186.55
结算备付金	23,755.17	-	-	-	23,755.17
存出保证金	36,980.42	-	-	-	36,980.42
交易性金融资产	-	-	-	-238,701,649.92	238,701,649.92
资产总计	2,414,922.14	-	-	-238,701,649.92	241,116,572.06
负债					
应付清算款	-	-	-	0.55	0.55
应付管理人报酬	-	-	-	92,960.09	92,960.09
应付托管费	-	-	-	14,460.48	14,460.48
其他负债	-	-	-	181,405.72	181,405.72
负债总计	-	-	-	288,826.84	288,826.84
利率敏感度缺口	2,414,922.14	-	-	-238,412,823.08	240,827,745.22
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	2,934,680.06	-	-	-	2,934,680.06
结算备付金	154,647.08	-	-	-	154,647.08
存出保证金	32,730.19	-	-	-	32,730.19
交易性金融资产	-	-	-	-242,436,189.52	242,436,189.52
资产总计	3,122,057.33	-	-	-242,436,189.52	245,558,246.85
负债					
应付清算款	-	-	-	0.44	0.44
应付管理人报酬	-	-	-	93,463.64	93,463.64
应付托管费	-	-	-	14,538.80	14,538.80
其他负债	-	-	-	397,011.27	397,011.27
负债总计	-	-	-	505,014.15	505,014.15
利率敏感度缺口	3,122,057.33	-	-	-241,931,175.37	245,053,232.70

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	238,701,649.92	99.12	242,436,189.52	98.93
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	238,701,649.92	99.12	242,436,189.52	98.93

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

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	11,881,921.90	12,090,896.76

	5%		
	业绩比较基准减少	-11,881,921.90	-12,090,896.76
	5%		

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	238,615,260.41	242,376,292.20
第二层次	45,200.81	-
第三层次	41,188.70	59,897.32
合计	238,701,649.92	242,436,189.52

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	238,701,649.92	99.00
	其中：股票	238,701,649.92	99.00
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	2,377,941.72	0.99
8	其他各项资产	36,980.42	0.02
9	合计	241,116,572.06	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	1,497,156.00	0.62
B	采矿业	11,140,569.68	4.63
C	制造业	150,872,144.90	62.65

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,614,256.81	3.99
E	建筑业	2,427,937.00	1.01
F	批发和零售业	5,059,583.20	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	4,800,075.50	1.99
H	住宿和餐饮业	755,047.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,975,735.52	7.05
J	金融业	22,163,627.19	9.20
K	房地产业	2,697,938.00	1.12
L	租赁和商务服务业	1,819,169.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	1,908,464.89	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	1,082,472.25	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	264,843.00	0.11
Q	卫生和社会工作	1,483,284.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	3,586,226.00	1.49
S	综合	426,624.00	0.18
	合计	238,575,153.94	99.06

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	113,544.79	0.05
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	5,392.95	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	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,139.12	0.00
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	126,495.98	0.05

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	300502	新易盛	28,500	3,008,175.00	1.25
2	002028	思源电气	24,714	1,653,366.60	0.69
3	601058	赛轮轮胎	105,800	1,481,200.00	0.62
4	688169	石头科技	3,742	1,469,109.20	0.61
5	600066	宇通客车	53,300	1,375,140.00	0.57
6	002340	格林美	206,300	1,314,131.00	0.55
7	000933	神火股份	63,300	1,280,559.00	0.53
8	601077	渝农商行	248,700	1,248,474.00	0.52
9	000988	华工科技	40,500	1,212,165.00	0.50
10	601168	西部矿业	67,100	1,204,445.00	0.50
11	300394	天孚通信	13,360	1,181,291.20	0.49
12	002384	东山精密	55,000	1,138,500.00	0.47
13	000423	东阿阿胶	18,100	1,133,060.00	0.47
14	000630	铜陵有色	308,900	1,115,129.00	0.46
15	600418	江淮汽车	70,300	1,113,552.00	0.46
16	600988	赤峰黄金	66,800	1,091,512.00	0.45
17	601233	桐昆股份	67,900	1,083,684.00	0.45
18	600157	永泰能源	903,100	1,065,658.00	0.44

19	002625	光启技术	60,600	1,051,410.00	0.44
20	600096	云天化	51,600	1,002,072.00	0.42
21	601567	三星医疗	28,400	994,000.00	0.41
22	000400	许继电气	28,700	987,567.00	0.41
23	002156	通富微电	42,600	953,814.00	0.40
24	688777	中控技术	25,286	953,282.20	0.40
25	002128	电投能源	45,100	951,610.00	0.40
26	002273	水晶光电	56,000	950,880.00	0.39
27	601555	东吴证券	159,620	941,758.00	0.39
28	002078	太阳纸业	67,400	940,230.00	0.39
29	600885	宏发股份	33,522	927,888.96	0.39
30	601128	常熟银行	121,163	917,203.91	0.38
31	002532	天山铝业	112,300	910,753.00	0.38
32	300207	欣旺达	60,000	910,200.00	0.38
33	002223	鱼跃医疗	24,200	909,920.00	0.38
34	600352	浙江龙盛	104,700	899,373.00	0.37
35	600398	海澜之家	96,600	892,584.00	0.37
36	002138	顺络电子	32,400	889,704.00	0.37
37	002966	苏州银行	118,060	885,450.00	0.37
38	002353	杰瑞股份	24,700	866,476.00	0.36
39	601108	财通证券	130,600	863,266.00	0.36
40	600765	中航重机	41,620	849,048.00	0.35
41	002185	华天科技	103,200	841,080.00	0.35
42	688617	惠泰医疗	1,842	840,136.20	0.35
43	002517	恺英网络	86,500	826,075.00	0.34
44	600879	航天电子	106,130	824,630.10	0.34
45	603606	东方电缆	16,600	810,246.00	0.34
46	301236	软通动力	23,000	809,830.00	0.34
47	600873	梅花生物	80,200	803,604.00	0.33
48	600177	雅戈尔	111,800	796,016.00	0.33
49	601577	长沙银行	97,000	793,460.00	0.33
50	688099	晶晨股份	13,332	790,854.24	0.33
51	600109	国金证券	104,500	788,975.00	0.33
52	600079	人福医药	45,900	788,103.00	0.33
53	002738	中矿资源	29,340	786,312.00	0.33
54	300003	乐普医疗	52,900	785,036.00	0.33
55	600060	海信视像	31,501	779,334.74	0.32
56	300017	网宿科技	98,000	774,200.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	143,420	765,862.80	0.32
58	603160	汇顶科技	11,100	763,125.00	0.32
59	300136	信维通信	38,900	761,662.00	0.32
60	603979	金诚信	14,800	747,844.00	0.31
61	002202	金风科技	111,000	745,920.00	0.31

62	002739	万达电影	61,300	741,117.00	0.31
63	689009	九号公司	20,060	738,408.60	0.31
64	000932	华菱钢铁	166,400	737,152.00	0.31
65	000683	远兴能源	104,900	724,859.00	0.30
66	600985	淮北矿业	43,300	724,842.00	0.30
67	002465	海格通信	69,900	724,164.00	0.30
68	002409	雅克科技	11,489	722,772.99	0.30
69	600536	中国软件	24,151	722,597.92	0.30
70	600348	华阳股份	72,378	720,884.88	0.30
71	002281	光迅科技	19,200	717,504.00	0.30
72	002444	巨星科技	29,000	716,300.00	0.30
73	000009	中国宝安	83,000	713,800.00	0.30
74	688120	华海清科	3,710	703,341.80	0.29
75	002008	大族激光	33,800	703,040.00	0.29
76	300474	景嘉微	11,100	701,853.00	0.29
77	002436	兴森科技	68,000	701,760.00	0.29
78	000878	云南铜业	56,300	701,498.00	0.29
79	688122	西部超导	18,250	699,340.00	0.29
80	600642	申能股份	78,700	694,921.00	0.29
81	601615	明阳智能	73,100	690,064.00	0.29
82	002797	第一创业	135,200	688,168.00	0.29
83	000039	中集集团	74,160	686,721.60	0.29
84	300054	鼎龙股份	30,200	684,936.00	0.28
85	601990	南京证券	88,900	682,752.00	0.28
86	300012	华测检测	67,800	682,068.00	0.28
87	000066	中国长城	77,900	681,625.00	0.28
88	600298	安琪酵母	24,400	681,492.00	0.28
89	600529	山东药玻	26,600	674,044.00	0.28
90	601666	平煤股份	59,700	668,640.00	0.28
91	600839	四川长虹	148,600	667,214.00	0.28
92	002673	西部证券	107,700	666,663.00	0.28
93	688525	佰维存储	10,344	663,567.60	0.28
94	601179	中国西电	82,500	663,300.00	0.28
95	603596	伯特利	17,000	661,300.00	0.27
96	000831	中国稀土	25,600	648,960.00	0.27
97	000783	长江证券	133,300	643,839.00	0.27
98	300395	菲利华	20,900	642,675.00	0.27
99	603816	顾家家居	19,900	642,571.00	0.27
100	601717	郑煤机	43,300	640,840.00	0.27
101	300002	神州泰岳	78,700	639,044.00	0.27
102	000728	国元证券	105,100	636,906.00	0.26
103	002432	九安医疗	15,700	636,478.00	0.26
104	000738	航发控制	31,700	636,219.00	0.26

105	688188	柏楚电子	3,424	631,899.20	0.26
106	600862	中航高科	33,600	631,008.00	0.26
107	000703	恒逸石化	88,400	626,756.00	0.26
108	688180	君实生物	21,512	624,923.60	0.26
109	601198	东兴证券	78,000	620,880.00	0.26
110	601997	贵阳银行	117,400	618,698.00	0.26
111	603345	安井食品	8,300	616,773.00	0.26
112	603338	浙江鼎力	10,200	616,284.00	0.26
113	000960	锡业股份	39,700	614,953.00	0.26
114	002595	豪迈科技	16,100	614,537.00	0.26
115	002155	湖南黄金	33,800	611,780.00	0.25
116	600863	内蒙华电	131,400	609,696.00	0.25
117	601162	天风证券	279,200	608,656.00	0.25
118	601696	中银证券	66,900	607,452.00	0.25
119	300037	新宙邦	21,240	606,614.40	0.25
120	300724	捷佳伟创	11,200	604,912.00	0.25
121	300866	安克创新	8,490	604,572.90	0.25
122	600038	中直股份	14,700	604,317.00	0.25
123	600521	华海药业	35,300	601,865.00	0.25
124	000921	海信家电	18,600	599,664.00	0.25
125	002294	信立泰	22,500	599,175.00	0.25
126	002472	双环传动	27,200	598,944.00	0.25
127	300001	特锐德	29,700	597,564.00	0.25
128	002984	森麒麟	24,800	597,432.00	0.25
129	603939	益丰药房	24,312	596,859.60	0.25
130	600141	兴发集团	31,000	591,480.00	0.25
131	600549	厦门钨业	34,200	589,950.00	0.24
132	600699	均胜电子	39,680	588,057.60	0.24
133	002407	多氟多	47,980	586,795.40	0.24
134	600546	山煤国际	39,800	581,876.00	0.24
135	002850	科达利	7,600	580,488.00	0.24
136	300699	光威复材	23,360	580,028.80	0.24
137	002262	恩华药业	24,300	576,882.00	0.24
138	600895	张江高科	31,200	576,576.00	0.24
139	600820	隧道股份	88,200	575,946.00	0.24
140	600369	西南证券	160,500	574,590.00	0.24
141	600872	中炬高新	25,300	574,057.00	0.24
142	300285	国瓷材料	32,100	572,985.00	0.24
143	002064	华峰化学	79,900	572,883.00	0.24
144	301358	湖南裕能	18,200	572,572.00	0.24
145	002195	岩山科技	228,000	572,280.00	0.24
146	000021	深科技	37,600	568,512.00	0.24
147	603589	口子窖	14,400	564,336.00	0.23

148	603087	甘李药业	12,100	560,472.00	0.23
149	600021	上海电力	56,600	559,774.00	0.23
150	601000	唐山港	119,000	559,300.00	0.23
151	300073	当升科技	16,300	559,253.00	0.23
152	300146	汤臣倍健	41,000	555,550.00	0.23
153	600486	扬农化工	9,760	550,952.00	0.23
154	000513	丽珠集团	14,719	547,693.99	0.23
155	300058	蓝色光标	100,100	544,544.00	0.23
156	601966	玲珑轮胎	29,600	543,752.00	0.23
157	600704	物产中大	125,000	542,500.00	0.23
158	603179	新泉股份	13,800	541,512.00	0.22
159	002756	永兴材料	15,100	540,278.00	0.22
160	600153	建发股份	60,300	538,479.00	0.22
161	300114	中航电测	11,900	538,475.00	0.22
162	600155	华创云信	90,900	537,219.00	0.22
163	000830	鲁西化工	46,100	534,299.00	0.22
164	688065	凯赛生物	11,715	531,743.85	0.22
165	300529	健帆生物	19,500	530,595.00	0.22
166	600118	中国卫星	23,700	526,851.00	0.22
167	600583	海油工程	88,900	525,399.00	0.22
168	002558	巨人网络	55,500	523,920.00	0.22
169	002152	广电运通	50,000	523,000.00	0.22
170	000591	太阳能	110,200	519,042.00	0.22
171	601156	东航物流	25,500	518,925.00	0.22
172	000623	吉林敖东	38,550	516,570.00	0.21
173	600970	中材国际	42,500	512,550.00	0.21
174	002025	航天电器	11,000	510,180.00	0.21
175	300373	扬杰科技	13,100	509,590.00	0.21
176	002439	启明星辰	29,500	509,170.00	0.21
177	002385	大北农	132,200	508,970.00	0.21
178	300144	宋城演艺	63,100	506,693.00	0.21
179	600380	健康元	45,045	503,152.65	0.21
180	605358	立昂微	21,700	502,138.00	0.21
181	601216	君正集团	135,700	500,733.00	0.21
182	000729	燕京啤酒	56,600	499,778.00	0.21
183	600143	金发科技	75,300	497,733.00	0.21
184	000723	美锦能源	104,500	497,420.00	0.21
185	300251	光线传媒	59,000	496,190.00	0.21
186	600998	九州通	101,507	495,354.16	0.21
187	600282	南钢股份	99,300	494,514.00	0.21
188	000519	中兵红箭	33,600	492,912.00	0.20
189	600637	东方明珠	81,000	492,480.00	0.20
190	300383	光环新网	57,800	488,410.00	0.20

191	600516	方大炭素	113,300	488,323.00	0.20
192	300677	英科医疗	18,200	487,942.00	0.20
193	600763	通策医疗	9,000	486,450.00	0.20
194	600392	盛和资源	56,400	486,168.00	0.20
195	300024	机器人	49,900	486,026.00	0.20
196	000636	风华高科	37,100	484,526.00	0.20
197	000818	航锦科技	21,900	483,552.00	0.20
198	002958	青农商行	178,600	478,648.00	0.20
199	601665	齐鲁银行	97,300	477,743.00	0.20
200	600909	华安证券	113,380	477,329.80	0.20
201	002044	美年健康	125,800	475,524.00	0.20
202	600008	首创环保	176,830	473,904.40	0.20
203	000883	湖北能源	78,600	472,386.00	0.20
204	600566	济川药业	14,800	469,308.00	0.19
205	601016	节能风电	156,310	467,366.90	0.19
206	000629	钒钛股份	186,900	467,250.00	0.19
207	600867	通化东宝	55,700	466,209.00	0.19
208	688213	思特威	9,605	465,842.50	0.19
209	600511	国药股份	15,100	464,929.00	0.19
210	300088	长信科技	98,517	463,029.90	0.19
211	601456	国联证券	48,000	462,720.00	0.19
212	000997	新大陆	33,100	460,421.00	0.19
213	600170	上海建工	214,000	460,100.00	0.19
214	600582	天地科技	66,500	458,185.00	0.19
215	600499	科达制造	54,100	456,063.00	0.19
216	600498	烽火通信	28,600	454,740.00	0.19
217	600535	天士力	36,000	452,880.00	0.19
218	601933	永辉超市	182,500	452,600.00	0.19
219	600004	白云机场	47,700	452,196.00	0.19
220	002120	韵达股份	58,300	451,242.00	0.19
221	000598	兴蓉环境	60,000	451,200.00	0.19
222	600129	太极集团	15,600	451,152.00	0.19
223	601991	大唐发电	149,400	449,694.00	0.19
224	000750	国海证券	154,180	448,663.80	0.19
225	002261	拓维信息	40,400	447,228.00	0.19
226	600580	卧龙电驱	36,800	447,120.00	0.19
227	000060	中金岭南	105,100	445,624.00	0.19
228	300118	东方日升	36,700	444,070.00	0.18
229	603000	人民网	22,200	443,778.00	0.18
230	300568	星源材质	54,100	443,620.00	0.18
231	300567	精测电子	7,800	440,778.00	0.18
232	002430	杭氧股份	19,800	440,550.00	0.18
233	603486	科沃斯	9,300	438,774.00	0.18

234	002429	兆驰股份	91,100	438,191.00	0.18
235	603658	安图生物	9,500	437,665.00	0.18
236	002939	长城证券	64,900	434,830.00	0.18
237	600166	福田汽车	193,100	434,475.00	0.18
238	603156	养元饮品	20,400	433,908.00	0.18
239	603228	景旺电子	13,580	431,844.00	0.18
240	600325	华发股份	66,400	431,600.00	0.18
241	600816	建元信托	158,600	429,806.00	0.18
242	601231	环旭电子	26,600	426,930.00	0.18
243	600673	东阳光	60,600	426,624.00	0.18
244	300765	新诺威	16,900	426,387.00	0.18
245	300487	蓝晓科技	10,200	425,952.00	0.18
246	603568	伟明环保	20,609	424,133.22	0.18
247	603927	中科软	23,380	422,944.20	0.18
248	600754	锦江酒店	18,400	422,832.00	0.18
249	002508	老板电器	19,100	422,110.00	0.18
250	000893	亚钾国际	26,100	421,776.00	0.18
251	300601	康泰生物	26,900	419,909.00	0.17
252	000027	深圳能源	57,340	418,582.00	0.17
253	002926	华西证券	63,453	418,155.27	0.17
254	601636	旗滨集团	64,700	417,315.00	0.17
255	688052	纳芯微	4,060	417,286.80	0.17
256	000998	隆平高科	42,400	416,792.00	0.17
257	002624	完美世界	54,600	414,960.00	0.17
258	002653	海思科	13,500	414,450.00	0.17
259	603298	杭叉集团	21,100	414,404.00	0.17
260	603290	斯达半导	4,800	413,328.00	0.17
261	002497	雅化集团	46,200	412,104.00	0.17
262	600737	中粮糖业	42,938	411,775.42	0.17
263	600563	法拉电子	5,400	411,372.00	0.17
264	300604	长川科技	15,100	410,267.00	0.17
265	300253	卫宁健康	69,500	410,050.00	0.17
266	601866	中远海发	158,900	409,962.00	0.17
267	002299	圣农发展	30,000	409,200.00	0.17
268	603077	和邦生物	247,900	409,035.00	0.17
269	600131	国网信通	24,200	408,254.00	0.17
270	002065	东华软件	90,200	407,704.00	0.17
271	002500	山西证券	86,500	406,550.00	0.17
272	002056	横店东磁	32,600	406,522.00	0.17
273	600373	中文传媒	27,300	405,132.00	0.17
274	601958	金钼股份	38,900	404,949.00	0.17
275	688772	珠海冠宇	27,167	404,788.30	0.17
276	688385	复旦微电	12,889	404,456.82	0.17

277	300390	天华新能	23,540	404,417.20	0.17
278	300009	安科生物	47,348	404,351.92	0.17
279	002414	高德红外	68,600	404,054.00	0.17
280	300763	锦浪科技	9,700	403,908.00	0.17
281	600655	豫园股份	78,100	402,215.00	0.17
282	688002	睿创微纳	14,296	399,859.12	0.17
283	603893	瑞芯微	6,700	396,439.00	0.16
284	002507	涪陵榨菜	32,340	396,165.00	0.16
285	002368	太极股份	17,521	395,098.55	0.16
286	002372	伟星新材	25,600	394,752.00	0.16
287	688114	华大智造	8,322	394,546.02	0.16
288	601611	中国核建	48,700	393,983.00	0.16
289	600707	彩虹股份	57,800	393,618.00	0.16
290	603885	吉祥航空	35,600	391,244.00	0.16
291	000887	中鼎股份	31,700	388,008.00	0.16
292	002203	海亮股份	48,200	384,636.00	0.16
293	002831	裕同科技	15,000	383,850.00	0.16
294	603379	三美股份	9,800	383,572.00	0.16
295	603225	新凤鸣	24,500	381,955.00	0.16
296	600755	厦门国贸	53,000	380,010.00	0.16
297	600859	王府井	32,100	376,854.00	0.16
298	688390	固德威	6,707	376,396.84	0.16
299	688521	芯原股份	13,977	373,884.75	0.16
300	601880	辽港股份	303,500	373,305.00	0.16
301	600329	达仁堂	11,489	372,128.71	0.15
302	600995	南网储能	38,400	370,944.00	0.15
303	600801	华新水泥	26,972	370,865.00	0.15
304	600416	湘电股份	37,300	370,762.00	0.15
305	600884	杉杉股份	45,400	368,648.00	0.15
306	002683	广东宏大	18,300	368,379.00	0.15
307	600390	五矿资本	90,700	367,335.00	0.15
308	300296	利亚德	81,500	366,750.00	0.15
309	300070	碧水源	87,500	366,625.00	0.15
310	002019	亿帆医药	29,600	365,856.00	0.15
311	002506	协鑫集成	188,400	365,496.00	0.15
312	600435	北方导航	42,300	364,626.00	0.15
313	002244	滨江集团	50,000	363,000.00	0.15
314	600483	福能股份	31,000	361,460.00	0.15
315	000050	深天马 A	49,500	360,360.00	0.15
316	600739	辽宁成大	42,900	359,073.00	0.15
317	300748	金力永磁	27,700	358,992.00	0.15
318	601098	中南传媒	28,800	357,696.00	0.15
319	600399	抚顺特钢	63,500	357,505.00	0.15

320	600598	北大荒	28,600	357,214.00	0.15
321	300803	指南针	9,800	356,818.00	0.15
322	601598	中国外运	63,200	355,816.00	0.15
323	002568	百润股份	21,100	355,113.00	0.15
324	002572	索菲亚	23,100	354,123.00	0.15
325	600901	江苏金租	70,100	354,005.00	0.15
326	002487	大金重工	15,400	352,352.00	0.15
327	000155	川能动力	32,700	352,179.00	0.15
328	300676	华大基因	10,000	350,100.00	0.15
329	600848	上海临港	38,400	349,824.00	0.15
330	002240	盛新锂能	26,000	348,920.00	0.14
331	002080	中材科技	26,900	347,010.00	0.14
332	001286	陕西能源	30,067	346,672.51	0.14
333	002373	千方科技	38,100	345,567.00	0.14
334	002936	郑州银行	199,057	344,368.61	0.14
335	002557	洽洽食品	12,200	343,918.00	0.14
336	300595	欧普康视	21,700	340,256.00	0.14
337	000563	陕国投 A	123,600	339,900.00	0.14
338	603712	七一二	18,603	338,388.57	0.14
339	002268	电科网安	23,751	337,976.73	0.14
340	600968	海油发展	82,000	337,840.00	0.14
341	601928	凤凰传媒	30,700	336,472.00	0.14
342	688017	绿的谐波	4,098	336,445.80	0.14
343	603858	步长制药	22,200	336,330.00	0.14
344	000778	新兴铸管	96,600	336,168.00	0.14
345	688301	奕瑞科技	2,905	334,743.15	0.14
346	603883	老百姓	18,199	334,133.64	0.14
347	600258	首旅酒店	26,900	332,215.00	0.14
348	688538	和辉光电	167,417	331,485.66	0.14
349	601212	白银有色	118,700	329,986.00	0.14
350	600271	航天信息	44,700	328,992.00	0.14
351	300558	贝达药业	10,100	328,755.00	0.14
352	600528	中铁工业	44,700	327,204.00	0.14
353	688536	思瑞浦	3,327	325,413.87	0.14
354	600062	华润双鹤	16,600	325,028.00	0.13
355	600977	中国电影	30,100	323,876.00	0.13
356	688234	天岳先进	6,892	323,372.64	0.13
357	601155	新城控股	36,400	322,868.00	0.13
358	002531	天顺风能	36,100	322,734.00	0.13
359	000709	河钢股份	165,700	321,458.00	0.13
360	603688	石英股份	10,850	321,268.50	0.13
361	603444	吉比特	1,800	320,418.00	0.13
362	002408	齐翔腾达	57,140	319,984.00	0.13

363	688005	容百科技	13,705	319,052.40	0.13
364	600378	昊华科技	11,000	317,900.00	0.13
365	000739	普洛药业	23,385	317,334.45	0.13
366	600959	江苏有线	120,200	317,328.00	0.13
367	601118	海南橡胶	69,000	313,950.00	0.13
368	688200	华峰测控	3,409	312,775.75	0.13
369	688220	翱捷科技	8,344	312,566.24	0.13
370	000825	太钢不锈	92,100	311,298.00	0.13
371	603882	金域医学	11,400	309,966.00	0.13
372	603737	三棵树	8,480	307,569.60	0.13
373	688331	荣昌生物	7,118	307,497.60	0.13
374	600056	中国医药	30,040	304,004.80	0.13
375	600517	国网英大	69,200	299,636.00	0.12
376	000987	越秀资本	60,405	299,608.80	0.12
377	600906	财达证券	52,100	298,533.00	0.12
378	601399	国机重装	115,600	298,248.00	0.12
379	603456	九洲药业	21,700	297,724.00	0.12
380	688032	禾迈股份	2,588	297,050.64	0.12
381	600612	老凤祥	5,100	296,769.00	0.12
382	601019	山东出版	25,100	296,682.00	0.12
383	300212	易华录	17,360	292,168.80	0.12
384	002266	浙富控股	104,557	291,714.03	0.12
385	600316	洪都航空	17,300	287,699.00	0.12
386	603650	彤程新材	9,700	286,635.00	0.12
387	000937	冀中能源	42,700	286,090.00	0.12
388	600871	石化油服	163,400	284,316.00	0.12
389	603529	爱玛科技	10,400	284,232.00	0.12
390	688567	孚能科技	29,417	282,403.20	0.12
391	600925	苏能股份	55,100	278,255.00	0.12
392	002423	中粮资本	36,900	276,381.00	0.11
393	000032	深桑达 A	18,300	274,134.00	0.11
394	601965	中国汽研	16,200	273,618.00	0.11
395	001227	兰州银行	114,500	272,510.00	0.11
396	600098	广州发展	42,300	270,720.00	0.11
397	600208	新湖中宝	170,900	270,022.00	0.11
398	601298	青岛港	28,200	269,592.00	0.11
399	603728	鸣志电器	6,700	269,541.00	0.11
400	688063	派能科技	6,770	268,836.70	0.11
401	002607	中公教育	173,100	264,843.00	0.11
402	601608	中信重工	69,500	264,795.00	0.11
403	002670	国盛金控	31,200	264,264.00	0.11
404	688297	中无人机	7,973	263,348.19	0.11
405	600663	陆家嘴	29,800	262,836.00	0.11

406	688516	奥特维	6,276	262,399.56	0.11
407	603233	大参林	18,340	262,262.00	0.11
408	600022	山东钢铁	214,800	262,056.00	0.11
409	600578	京能电力	80,700	261,468.00	0.11
410	688561	奇安信	11,032	260,575.84	0.11
411	300438	鹏辉能源	14,200	260,428.00	0.11
412	300357	我武生物	12,700	256,794.00	0.11
413	601106	中国一重	110,400	255,024.00	0.11
414	600500	中化国际	72,400	252,676.00	0.10
415	600377	宁沪高速	19,900	250,740.00	0.10
416	003031	中瓷电子	5,380	248,771.20	0.10
417	300776	帝尔激光	5,380	247,264.80	0.10
418	600967	内蒙一机	34,300	246,960.00	0.10
419	002865	钧达股份	6,400	245,632.00	0.10
420	000785	居然之家	100,700	244,701.00	0.10
421	600315	上海家化	13,700	243,586.00	0.10
422	600350	山东高速	27,200	240,720.00	0.10
423	688029	南微医学	3,896	239,837.76	0.10
424	300888	稳健医疗	9,420	238,326.00	0.10
425	688425	铁建重工	64,577	237,643.36	0.10
426	600827	百联股份	32,200	237,636.00	0.10
427	688349	三一重能	9,539	236,948.76	0.10
428	000958	电投产融	64,700	236,802.00	0.10
429	601568	北元集团	63,720	236,401.20	0.10
430	000559	万向钱潮	53,000	236,380.00	0.10
431	000537	中绿电	24,800	236,344.00	0.10
432	002608	江苏国信	30,400	235,600.00	0.10
433	000156	华数传媒	37,400	234,872.00	0.10
434	002690	美亚光电	14,160	233,640.00	0.10
435	603707	健友股份	19,511	231,790.68	0.10
436	002867	周大生	17,700	231,162.00	0.10
437	603517	绝味食品	14,900	229,460.00	0.10
438	601992	金隅集团	167,100	228,927.00	0.10
439	603826	坤彩科技	7,840	227,124.80	0.09
440	600126	杭钢股份	54,300	223,173.00	0.09
441	300682	朗新集团	26,200	222,962.00	0.09
442	003022	联泓新科	16,000	219,360.00	0.09
443	000967	盈峰环境	51,000	215,730.00	0.09
444	603218	日月股份	20,800	213,616.00	0.09
445	688475	萤石网络	6,244	212,982.84	0.09
446	600032	浙江新能	29,100	211,848.00	0.09
447	603786	科博达	3,300	211,695.00	0.09
448	301267	华夏眼科	10,200	211,344.00	0.09

449	600339	中油工程	67,700	211,224.00	0.09
450	600361	创新新材	52,100	209,963.00	0.09
451	600481	双良节能	44,900	209,683.00	0.09
452	688778	厦钨新能	6,700	209,308.00	0.09
453	688281	华秦科技	2,512	209,299.84	0.09
454	688520	神州细胞	5,264	207,138.40	0.09
455	000898	鞍钢股份	96,700	205,004.00	0.09
456	600095	湘财股份	34,300	204,428.00	0.08
457	003035	南网能源	45,900	201,960.00	0.08
458	603127	昭衍新药	15,168	201,279.36	0.08
459	688248	南网科技	6,731	199,439.53	0.08
460	600808	马钢股份	97,100	196,142.00	0.08
461	002563	森马服饰	32,500	188,825.00	0.08
462	002153	石基信息	32,804	187,966.92	0.08
463	603185	弘元绿能	10,900	186,281.00	0.08
464	601228	广州港	60,400	184,220.00	0.08
465	000539	粤电力 A	35,700	181,356.00	0.08
466	688779	长远锂科	38,799	179,639.37	0.07
467	001872	招商港口	9,302	179,063.50	0.07
468	600928	西安银行	53,500	174,945.00	0.07
469	000401	冀东水泥	43,000	174,580.00	0.07
470	001203	大中矿业	18,100	173,941.00	0.07
471	000959	首钢股份	62,600	170,272.00	0.07
472	688006	杭可科技	9,710	169,439.50	0.07
473	002518	科士达	9,500	168,150.00	0.07
474	600764	中国海防	8,500	166,855.00	0.07
475	603056	德邦股份	12,500	163,750.00	0.07
476	603305	旭升集团	15,000	158,400.00	0.07
477	688172	燕东微	9,595	155,247.10	0.06
478	600299	安迪苏	16,000	155,200.00	0.06
479	601139	深圳燃气	23,100	154,308.00	0.06
480	300861	美畅股份	7,700	148,995.00	0.06
481	603317	天味食品	12,939	147,633.99	0.06
482	688276	百克生物	4,886	138,615.82	0.06
483	688387	信科移动	27,419	138,191.76	0.06
484	688375	国博电子	1,949	137,677.36	0.06
485	301029	怡合达	6,960	136,833.60	0.06
486	688819	天能股份	5,541	132,208.26	0.05
487	002791	坚朗五金	5,100	131,937.00	0.05
488	600927	永安期货	11,700	130,455.00	0.05
489	688153	唯捷创芯	3,380	125,060.00	0.05
490	601858	中国科传	6,400	122,368.00	0.05
491	000031	大悦城	51,800	121,212.00	0.05

492	688107	安路科技	4,731	120,262.02	0.05
493	601158	重庆水务	23,300	111,840.00	0.05
494	601828	美凯龙	43,700	111,435.00	0.05
495	002945	华林证券	10,800	107,784.00	0.04
496	688348	昱能科技	1,766	104,194.00	0.04
497	600956	新天绿能	12,300	100,491.00	0.04
498	301165	锐捷网络	2,800	83,552.00	0.03
499	688295	中复神鹰	3,986	80,915.80	0.03
500	603868	飞科电器	2,000	76,800.00	0.03

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	603381	永臻股份	1,111	30,786.56	0.01
2	603285	键邦股份	1,265	23,592.25	0.01
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
4	001389	广合科技	204	7,050.24	0.00
5	601061	中信金属	785	5,392.95	0.00
6	601033	永兴股份	322	5,139.12	0.00
7	603341	龙旗科技	132	4,948.68	0.00
8	001359	平安电工	158	3,254.80	0.00
9	603344	星德胜	136	3,081.76	0.00
10	603082	北自科技	101	2,978.49	0.00
11	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
12	603325	博隆技术	37	2,518.22	0.00
13	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
14	603004	鼎龙科技	140	2,373.00	0.00
15	603375	盛景微	61	2,372.90	0.00
16	001379	腾达科技	164	2,210.72	0.00
17	603312	西典新能	86	2,180.96	0.00
18	001358	兴欣新材	95	1,949.40	0.00
19	400174	中天 3	202,200	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	688777	中控技术	1,104,890.84	0.45
2	601567	三星医疗	979,651.00	0.40
3	002202	金风科技	835,688.20	0.34
4	688617	惠泰医疗	824,132.20	0.34
5	601615	明阳智能	777,975.00	0.32

6	002436	兴森科技	777,840.00	0.32
7	603979	金诚信	766,212.00	0.31
8	301358	湖南裕能	759,621.00	0.31
9	300002	神州泰岳	731,606.00	0.30
10	000921	海信家电	725,187.00	0.30
11	300054	鼎龙股份	714,104.00	0.29
12	603345	安井食品	677,654.00	0.28
13	600872	中炬高新	675,415.00	0.28
14	300502	新易盛	663,490.00	0.27
15	002984	森麒麟	638,685.00	0.26
16	603179	新泉股份	592,307.00	0.24
17	688525	佰维存储	588,571.81	0.24
18	603087	甘李药业	577,932.00	0.24
19	000818	航锦科技	552,434.00	0.23
20	688065	凯赛生物	549,424.17	0.22

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	002463	沪电股份	2,169,871.00	0.89
2	002422	科伦药业	1,847,765.00	0.75
3	000975	银泰黄金	1,519,328.60	0.62
4	300418	昆仑万维	1,373,119.00	0.56
5	600160	巨化股份	1,242,941.00	0.51
6	600161	天坛生物	1,059,604.00	0.43
7	600415	小商品城	924,856.00	0.38
8	600482	中国动力	837,405.00	0.34
9	688072	拓荆科技	801,487.89	0.33
10	002600	领益智造	699,468.00	0.29
11	002131	利欧股份	481,163.00	0.20
12	688728	格科微	433,885.70	0.18
13	002032	苏泊尔	417,778.35	0.17
14	000581	威孚高科	401,209.00	0.16
15	000547	航天发展	388,472.00	0.16
16	002966	苏州银行	384,624.00	0.16
17	002092	ST 中泰	382,025.00	0.16
18	300394	天孚通信	380,881.00	0.16
19	300026	红日药业	371,725.00	0.15
20	000970	中科三环	363,148.20	0.15

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	62,230,276.60
卖出股票收入（成交）总额	47,925,195.37

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本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,980.42
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	36,980.42

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	603285	键邦股份	21,223.70	0.01	新股未上市
1	603285	键邦股份	2,368.55	0.00	新股锁定
2	603350	安乃达	19,429.20	0.01	新股未上市
2	603350	安乃达	2,179.36	0.00	新股锁定
3	001389	广合科技	7,050.24	0.00	新股锁定
4	603381	永臻股份	2,814.56	0.00	新股锁定

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

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 (%)
426	109,106.52	44,900,475.00	96.60	1,578,904.00	3.40

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 (%)
中国银行股份有限公司-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	11,472,600.00	24.68

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	国开金融有限责任公司	28,282,724.00	60.85
2	工银瑞信基金-浦发银行-工银瑞信睿承进取 FOF 策略 1 号集合资产管理计划	1,499,800.00	3.23
3	招商证券股份有限公司	1,141,059.00	2.45
4	中信建投证券股份有限公司	434,074.00	0.93
5	工银瑞信基金-光大银行-工银瑞信睿承进取 FOF 策略 2 号集合资产管理计划	421,000.00	0.91
6	中信证券股份有限公司	405,022.00	0.87
7	北京宏量资本管理有限公司-宏量鼎诚私募证券投资基金	300,000.00	0.65
8	海通证券股份有限公司	277,900.00	0.60
9	广发证券股份有限公司	270,331.00	0.58

	司		
10	中国银河证券股份有 限公司	202,266.00	0.44
11	中国银行股份有限公司-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	11,472,600.00	24.68

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、基金投资和研究部门 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（2019 年 10 月 17 日） 基金份额总额	1,080,968,281.00
本报告期期初基金份额总额	43,479,379.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	46,479,379.00

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

1、基金管理人

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

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

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	44,567,384.83	40.60	28,340.63	40.60	-
国泰君安	1	35,429,189.27	32.28	22,530.61	32.28	-
民生证券	1	29,768,511.77	27.12	18,930.35	27.12	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	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。

本报告期内本基金退租第一创业 1 个交易单元、中银国际 1 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
中信证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于终止	中国证监会规定的媒介	2024 年 1 月 23 日

	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		
2	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京中期时代销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 2 月 29 日

§ 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	20240101-20240630	28,282,724.00	-	-	28,282,724.00	60.85
	2	20240101-20240630	10,890,600.00	1,031,600.00	449,600.00	11,472,600.00	24.68
个人	-	-	-	-	-	-	-

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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 500 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

工银瑞信基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日