

# 工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
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 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	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 .....	11
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	38
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 .....	52

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 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	68,979,379.00 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
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
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 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 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	王海璐	刘连舸

## 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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	97,985,883.61
本期利润	69,897,753.52
加权平均基金份额本期利润	0.6602
本期加权平均净值利润率	12.18%
本期基金份额净值增长率	11.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	40,553,287.43
期末可供分配基金份额利润	0.5879
期末基金资产净值	404,314,134.14
期末基金份额净值	5.8614
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	13.32%

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

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

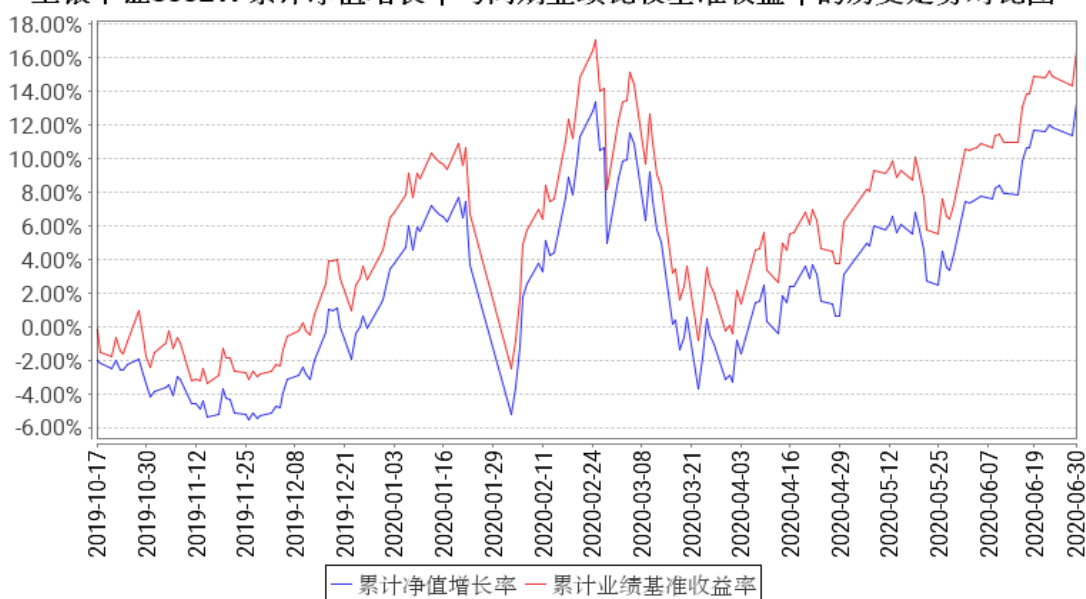
### 3.2 基金净值表现

#### 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	8.66%	0.87%	8.47%	0.88%	0.19%	-0.01%
过去三个月	16.65%	1.12%	16.32%	1.13%	0.33%	-0.01%
过去六个月	11.56%	1.76%	11.33%	1.79%	0.23%	-0.03%
自基金合同生效起至今	13.32%	1.53%	16.40%	1.56%	-3.08%	-0.03%

#### 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。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一

年。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的投资应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：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%。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、私募资产管理计划、企业年金、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、企业年金养老产品、职业年金等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金等逾 150 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流



的投资管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	本基金的基金经理	2019 年 10 月 17 日	-	10 年	中国人民大学金融工程博士；2010 年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心产品及营销支持部研究负责人兼指数基金基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银深证 100 指数分级基金（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，担任工银沪深 300 指数基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银中证 500 指数分级基金（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；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理；2015 年 7 月 23 日至今，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理；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，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 11 月 1 日至今，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 日至今，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 日至今，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。
赵栩	指数投资	2019 年	-	12 年	2008 年加入工银瑞信，曾任风险管理部金

	中心投资部 副 总 监，本基金的基金经理	10 月 17 日			融工程分析师，现任指数投资中心投资部副总监，2011 年 10 月 18 日至今担任工银上证央企 ETF 基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今担任工银深证红利 ETF 基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今担任工银深证红利 ETF 连接基金基金经理，2015 年 7 月 9 日至今担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理，2015 年 7 月 9 日至今担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理，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 日至今，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。
--	----------------------	-----------	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控

制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 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

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) 指数成份股调整的影响；4) 建仓期仓位变动等因素的影响。

#### 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 11.56%，业绩比较基准收益率为 11.33%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

(1) 职责分工

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

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

(2) 专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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合规守信、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”部分未在托管人复核范围内）、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,857,441.31	5,718,417.94
结算备付金		902,676.76	7,095,816.27
存出保证金		229,850.65	169,512.56
交易性金融资产	6.4.7.2	400,111,277.91	1,086,724,011.25
其中：股票投资		400,111,277.91	1,086,724,011.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		541,007.58	-
应收利息	6.4.7.5	1,076.36	4,849.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		406,643,330.57	1,099,712,607.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		165,583.13	405,918.26
应付托管费		25,757.39	63,142.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	283,421.79	1,092,302.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,854,434.12	145,670.98
负债合计		2,329,196.43	1,707,034.14
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	356,803,245.93	1,080,968,281.00
未分配利润	6.4.7.10	47,510,888.21	17,037,292.63
所有者权益合计		404,314,134.14	1,098,005,573.63
负债和所有者权益总计		406,643,330.57	1,099,712,607.77

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 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 5.8614 元，基金份额总额为 68,979,379.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		73,234,840.12
1. 利息收入		45,382.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,382.67
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-

证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		101,909,274.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	98,617,754.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	3,291,520.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-28,088,130.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-631,687.28
减：二、费用		3,337,086.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,284,585.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	199,824.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,605,275.29
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	247,401.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		69,897,753.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,897,753.52

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,080,968,281.00	17,037,292.63	1,098,005,573.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	69,897,753.52	69,897,753.52
三、本期基金份	-724,165,035.07	-39,424,157.94	-763,589,193.01

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	478,466,184.08	26,754,616.66	505,220,800.74
2. 基金赎回款	-1,202,631,219.15	-66,178,774.60	-1,268,809,993.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	356,803,245.93	47,510,888.21	404,314,134.14

注: 本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

王海璐

赵紫英

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”)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[2019]220 号《关于准予工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,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。本基金为契约型的交易型开放式基金,• 存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,080,938,281.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0550 号验资报告予以验证。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,其中认购资金利息折合 30,000.00 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(以下简称“中国银行”)。

根据《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》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,857,441.31
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	4,857,441.31

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	363,231,311.72	400,111,277.91	36,879,966.19
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	363,231,311.72	400,111,277.91	36,879,966.19

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**

无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	566.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	406.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	103.40
合计	1,076.36

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	283,421.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	283,421.79

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 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	-
预提审计费	40,278.42
指数使用费	36,659.28
预提信息披露费	59,672.34
IOPV 服务费	49,451.40
应退替代款	1,666,716.28
可退替代款	1,656.40
合计	1,854,434.12

注：1、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额；

2、应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	208,979,379.00	1,080,968,281.00
本期申购	92,500,000.00	478,466,184.08
本期赎回（以“-”号填列）	-232,500,000.00	-1,202,631,219.15
- 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	68,979,379.00	356,803,245.93

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

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-47,930,803.65	64,968,096.28	17,037,292.63
本期利润	97,985,883.61	-28,088,130.09	69,897,753.52
本期基金份额交易产生的变动数	-9,501,792.53	-29,922,365.41	-39,424,157.94
其中：基金申购款	20,607,937.79	6,146,678.87	26,754,616.66
基金赎回款	-30,109,730.32	-36,069,044.28	-66,178,774.60
本期已分配利润	-	-	-

本期末	40,553,287.43	6,957,600.78	47,510,888.21
-----	---------------	--------------	---------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
活期存款利息收入		33,647.70
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		9,591.69
其他		2,143.28
合计		45,382.67

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		69,396,292.55
股票投资收益——赎回差价收入		29,221,462.21
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		98,617,754.76

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
卖出股票成交总额		779,236,061.95
减：卖出股票成本总额		709,839,769.40
买卖股票差价收入		69,396,292.55

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
赎回基金份额对价总额		1,268,809,993.75
减：现金支付赎回款总额		684,285,185.75
减：赎回股票成本总额		555,303,345.79
赎回差价收入		29,221,462.21

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,291,520.06
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	3,291,520.06

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-28,088,130.09
股票投资	-28,088,130.09
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	-28,088,130.09
----	----------------

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-631,687.28
合计	-631,687.28

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

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,605,275.29
银行间市场交易费用	-
合计	1,605,275.29

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	40,278.42
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	49,451.40
银行费用	12,360.76
指数使用费	85,639.01
合计	247,401.93

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,284,585.00
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.45% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% / \text{当年天数}$$

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，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	199,824.38

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自有资金投资本基金的情况

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	27,620,000.00	40.04	-	-

## 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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,857,441.31	33,647.70

## 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(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股流通受限	5.00	6.54	48,900	244,500.00	319,806.00	-

		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

#### 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
601880	大连港	2020年6月22日	重大事项	1.72	2020年7月8日	1.89	252,600	471,474.61	434,472.00	-
002470	*ST金正	2020年6月30日	重大事项	2.27	2020年7月1日	2.16	132,800	354,351.41	301,456.00	-

#### 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属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，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，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第

一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施。在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策，公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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%。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

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

#### 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

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----



资产							
银行存款	4,857,441.31	-	-	-	-	-	-4,857,441.31
结算备付金	902,676.76	-	-	-	-	-	902,676.76
存出保证金	229,850.65	-	-	-	-	-	229,850.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	400,111,277.91	400,111,277.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	541,007.58	541,007.58
应收利息	-	-	-	-	-	1,076.36	1,076.36
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,989,968.72	-	-	-	-	400,653,361.85	406,643,330.57
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	165,583.13	165,583.13
应付托管费	-	-	-	-	-	25,757.39	25,757.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	283,421.79	283,421.79
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,854,434.12	1,854,434.12
负债总计	-	-	-	-	-	2,329,196.43	2,329,196.43
利率敏感度缺	5,989,968.7	-	-	-	-	398,324,165.42	404,314,134.

口	2						14
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,718,417.94	-	-	-	-	-	-5,718,417.94
结算备付金	7,095,816.27	-	-	-	-	-	-7,095,816.27
存出保证金	169,512.56	-	-	-	-	-	169,512.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,086,724,011.25	1,086,724,011.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,849.75	4,849.75
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,983,746.77	-	-	-	-	1,086,728,861.00	1,099,712,607.77
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	405,918.26	405,918.26
应付托管费	-	-	-	-	-	63,142.83	63,142.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,092,302.07	1,092,302.07
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	145,670.98	145,670.98
负债总计	-	-	-	-	-	1,707,034.14	1,707,034.14
利率敏感度缺口	12,983,746.77	-	-	-	-	1,085,021,826.86	1,098,005,573.63

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制策略，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。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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	400,111,277.91	98.96	1,086,724,011.25	98.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	400,111,277.91	98.96	1,086,724,011.25	98.97

注：1、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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	19,946,522.17	42,645,941.05
	业绩比较基准减少 5%	-19,946,522.17	-42,645,941.05

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	400,111,277.91	98.39
	其中：股票	400,111,277.91	98.39
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	5,760,118.07	1.42
8	其他各项资产	771,934.59	0.19
9	合计	406,643,330.57	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	3,598,682.00	0.89
B	采矿业	9,519,046.50	2.35
C	制造业	233,055,199.46	57.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,130,025.60	2.26
E	建筑业	5,173,715.00	1.28
F	批发和零售业	22,295,696.22	5.51
G	交通运输、仓储和邮政业	8,365,275.26	2.07
H	住宿和餐饮业	1,339,374.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,052,550.55	11.14

J	金融业	20,595,719.33	5.09
K	房地产业	14,079,497.99	3.48
L	租赁和商务服务业	8,164,753.00	2.02
M	科学研究和技术服务业	2,894,283.00	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	3,827,300.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	394,128.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,936,000.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	6,243,537.00	1.54
S	综合	3,446,495.00	0.85
	合计	400,111,277.91	98.96

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

无。

### 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	300253	卫宁健康	139,100	3,190,954.00	0.79
2	002127	南极电商	140,200	2,968,034.00	0.73
3	002821	凯莱英	11,100	2,697,300.00	0.67
4	600201	生物股份	91,474	2,546,636.16	0.63
5	002185	华天科技	178,700	2,417,811.00	0.60
6	600739	辽宁成大	124,700	2,360,571.00	0.58
7	300558	贝达药业	16,500	2,309,670.00	0.57
8	600529	山东药玻	38,600	2,238,800.00	0.55
9	002439	启明星辰	53,100	2,233,917.00	0.55
10	300088	长信科技	199,117	2,230,110.40	0.55
11	002385	大北农	239,700	2,183,667.00	0.54
12	300012	华测检测	108,300	2,140,008.00	0.53
13	002131	利欧股份	550,100	2,123,386.00	0.53

14	300285	国瓷材料	62,700	2,101,077.00	0.52
15	600079	人福医药	76,900	2,093,218.00	0.52
16	603444	吉比特	3,700	2,031,337.00	0.50
17	600521	华海药业	59,500	2,018,835.00	0.50
18	600298	安琪酵母	40,200	1,989,096.00	0.49
19	002465	海格通信	150,200	1,943,588.00	0.48
20	600161	天坛生物	42,600	1,931,058.00	0.48
21	600143	金发科技	145,700	1,918,869.00	0.47
22	002075	沙钢股份	144,300	1,803,750.00	0.45
23	000009	中国宝安	210,300	1,789,653.00	0.44
24	002223	鱼跃医疗	49,000	1,783,600.00	0.44
25	300496	中科创达	22,700	1,763,790.00	0.44
26	601099	太平洋	555,400	1,760,618.00	0.44
27	300482	万孚生物	16,900	1,757,600.00	0.43
28	002212	南洋股份	66,000	1,754,280.00	0.43
29	603517	绝味食品	24,600	1,740,204.00	0.43
30	002074	国轩高科	64,090	1,720,175.60	0.43
31	000636	风华高科	58,500	1,707,615.00	0.42
32	002273	水晶光电	99,400	1,703,716.00	0.42
33	300595	欧普康视	24,550	1,702,297.00	0.42
34	603882	金域医学	19,000	1,700,500.00	0.42
35	300207	欣旺达	89,500	1,691,550.00	0.42
36	601128	常熟银行	223,794	1,680,692.94	0.42
37	300418	昆仑万维	66,800	1,667,328.00	0.41
38	300315	掌趣科技	224,900	1,648,517.00	0.41
39	600426	华鲁恒升	92,600	1,637,168.00	0.40
40	002507	涪陵榨菜	45,300	1,631,253.00	0.40
41	603939	益丰药房	17,560	1,597,960.00	0.40
42	000988	华工科技	65,300	1,595,279.00	0.39
43	300357	我武生物	25,500	1,587,375.00	0.39
44	002340	格林美	311,600	1,548,652.00	0.38
45	002603	以岭药业	49,100	1,531,429.00	0.38
46	000975	银泰黄金	96,900	1,519,392.00	0.38
47	002414	高德红外	51,640	1,512,019.20	0.37
48	300168	万达信息	67,700	1,494,139.00	0.37
49	300271	华宇软件	52,800	1,489,488.00	0.37
50	300212	易华录	26,400	1,478,400.00	0.37
51	600132	重庆啤酒	20,100	1,467,300.00	0.36
52	002373	千方科技	61,100	1,465,789.00	0.36
53	002353	杰瑞股份	47,200	1,463,200.00	0.36
54	000513	丽珠集团	30,419	1,460,416.19	0.36
55	600699	均胜电子	60,860	1,449,076.60	0.36

56	600885	宏发股份	36,073	1,447,248.76	0.36
57	600859	王府井	31,700	1,443,935.00	0.36
58	000547	航天发展	104,400	1,427,148.00	0.35
59	002156	通富微电	56,500	1,415,325.00	0.35
60	601799	星宇股份	11,100	1,409,700.00	0.35
61	002019	亿帆医药	60,800	1,396,576.00	0.35
62	300024	机器人	102,100	1,395,707.00	0.35
63	300009	安科生物	77,490	1,387,071.00	0.34
64	002797	第一创业	199,700	1,381,924.00	0.34
65	002030	达安基因	49,670	1,354,997.60	0.34
66	603858	步长制药	46,800	1,350,180.00	0.33
67	002500	山西证券	206,200	1,348,548.00	0.33
68	300017	网宿科技	158,800	1,348,212.00	0.33
69	000750	国海证券	310,480	1,347,483.20	0.33
70	002557	洽洽食品	24,600	1,333,074.00	0.33
71	002250	联化科技	60,600	1,321,080.00	0.33
72	603233	大参林	16,236	1,318,687.92	0.33
73	600801	华新水泥	55,572	1,317,612.12	0.33
74	000021	深科技	60,300	1,316,349.00	0.33
75	002174	游族网络	50,400	1,314,432.00	0.33
76	002195	二三四五	467,000	1,312,270.00	0.32
77	600315	上海家化	27,300	1,307,670.00	0.32
78	002138	顺络电子	52,400	1,307,380.00	0.32
79	300316	晶盛机电	52,200	1,291,428.00	0.32
80	600380	健康元	79,145	1,285,314.80	0.32
81	000050	深天马 A	83,600	1,284,096.00	0.32
82	600895	张江高科	62,700	1,277,199.00	0.32
83	002152	广电运通	98,200	1,270,708.00	0.31
84	300058	蓝色光标	162,300	1,265,940.00	0.31
85	300070	碧水源	154,700	1,256,164.00	0.31
86	000998	隆平高科	75,400	1,255,410.00	0.31
87	600486	扬农化工	15,200	1,254,000.00	0.31
88	002572	索菲亚	51,800	1,252,006.00	0.31
89	600845	宝信软件	20,980	1,239,498.40	0.31
90	300244	迪安诊断	35,000	1,235,500.00	0.31
91	000401	冀东水泥	76,400	1,225,456.00	0.30
92	600410	华胜天成	89,600	1,218,560.00	0.30
93	600667	太极实业	102,900	1,216,278.00	0.30
94	002078	太阳纸业	127,000	1,209,040.00	0.30
95	603338	浙江鼎力	15,947	1,208,304.19	0.30
96	600037	歌华有线	79,157	1,203,186.40	0.30
97	600535	天士力	73,800	1,197,036.00	0.30



98	300274	阳光电源	83,100	1,195,809.00	0.30
99	000623	吉林敖东	75,950	1,194,693.50	0.30
100	600155	华创阳安	99,200	1,189,408.00	0.29
101	002511	中顺洁柔	53,300	1,188,590.00	0.29
102	002396	星网锐捷	33,600	1,187,088.00	0.29
103	600642	申能股份	200,100	1,182,591.00	0.29
104	002382	蓝帆医疗	39,100	1,177,301.00	0.29
105	000630	铜陵有色	601,300	1,160,509.00	0.29
106	002013	中航机电	146,500	1,157,350.00	0.29
107	603707	健友股份	17,800	1,149,346.00	0.28
108	601233	桐昆股份	90,000	1,148,400.00	0.28
109	600126	杭钢股份	110,000	1,144,000.00	0.28
110	002690	美亚光电	21,700	1,141,420.00	0.28
111	600879	航天电子	177,230	1,141,361.20	0.28
112	002926	华西证券	106,753	1,134,784.39	0.28
113	600153	建发股份	138,500	1,121,850.00	0.28
114	000739	普洛药业	47,985	1,117,570.65	0.28
115	300010	立思辰	56,700	1,109,619.00	0.27
116	002281	光迅科技	33,500	1,100,810.00	0.27
117	600884	杉杉股份	92,370	1,089,042.30	0.27
118	600415	小商品城	221,900	1,080,653.00	0.27
119	600167	联美控股	75,000	1,075,500.00	0.27
120	603659	璞泰来	10,400	1,071,408.00	0.26
121	001914	招商积余	34,810	1,069,711.30	0.26
122	600811	东方集团	242,000	1,069,640.00	0.26
123	600216	浙江医药	55,000	1,059,300.00	0.26
124	600804	鹏博士	116,700	1,047,966.00	0.26
125	600728	佳都科技	114,600	1,044,006.00	0.26
126	300251	光线传媒	95,600	1,042,996.00	0.26
127	300001	特锐德	48,800	1,021,872.00	0.25
128	002268	卫士通	47,851	1,021,140.34	0.25
129	300115	长盈精密	44,600	1,019,110.00	0.25
130	002294	信立泰	34,100	1,011,406.00	0.25
131	002028	思源电气	49,214	1,006,918.44	0.25
132	600909	华安证券	147,000	1,004,010.00	0.25
133	600779	水井坊	16,014	999,593.88	0.25
134	600511	国药股份	24,400	992,348.00	0.25
135	000581	威孚高科	47,800	988,504.00	0.24
136	300002	神州泰岳	159,600	987,924.00	0.24
137	600325	华发股份	137,900	973,574.00	0.24
138	000686	东北证券	114,700	969,215.00	0.24
139	000997	新大陆	60,200	961,996.00	0.24

140	600528	中铁工业	108,300	955,206.00	0.24
141	601689	拓普集团	34,200	954,180.00	0.24
142	600418	江淮汽车	108,000	953,640.00	0.24
143	002387	维信诺	66,563	950,519.64	0.24
144	600446	金证股份	48,600	942,840.00	0.23
145	000999	华润三九	32,280	942,253.20	0.23
146	600827	百联股份	65,200	942,140.00	0.23
147	600460	士兰微	63,870	937,611.60	0.23
148	600598	北大荒	58,000	933,800.00	0.23
149	603883	老百姓	9,260	926,370.40	0.23
150	002242	九阳股份	24,800	924,296.00	0.23
151	600959	江苏有线	244,600	919,696.00	0.23
152	600733	北汽蓝谷	142,800	918,204.00	0.23
153	002317	众生药业	53,100	911,196.00	0.23
154	603806	福斯特	18,158	906,265.78	0.22
155	601168	西部矿业	155,600	902,480.00	0.22
156	603000	人民网	45,400	900,282.00	0.22
157	600256	广汇能源	332,700	898,290.00	0.22
158	002368	太极股份	20,244	884,460.36	0.22
159	000878	云南铜业	83,100	881,691.00	0.22
160	000564	供销大集	196,000	880,040.00	0.22
161	600260	凯乐科技	65,000	878,800.00	0.22
162	300296	利亚德	144,500	877,115.00	0.22
163	600820	隧道股份	153,700	868,405.00	0.21
164	600704	物产中大	206,000	867,260.00	0.21
165	300113	顺网科技	34,000	863,600.00	0.21
166	002670	国盛金控	94,300	862,845.00	0.21
167	600839	四川长虹	300,600	862,722.00	0.21
168	002081	金螳螂	109,100	857,526.00	0.21
169	600497	驰宏锌锗	248,720	855,596.80	0.21
170	300166	东方国信	68,700	852,567.00	0.21
171	600673	东阳光	123,000	849,930.00	0.21
172	002124	天邦股份	65,900	846,815.00	0.21
173	002080	中材科技	54,600	846,300.00	0.21
174	300630	普利制药	11,400	843,030.00	0.21
175	600008	首创股份	277,700	835,877.00	0.21
176	600572	康恩贝	151,900	835,450.00	0.21
177	002221	东华能源	94,200	828,018.00	0.20
178	603866	桃李面包	16,200	824,418.00	0.20
179	600718	东软集团	71,100	817,650.00	0.20
180	002920	德赛西威	13,300	815,689.00	0.20
181	600549	厦门钨业	68,800	814,592.00	0.20

182	000158	常山北明	78,000	814,320.00	0.20
183	300618	寒锐钴业	13,100	812,462.00	0.20
184	000800	一汽解放	75,600	811,944.00	0.20
185	601179	中国西电	167,500	810,700.00	0.20
186	300026	红日药业	146,800	810,336.00	0.20
187	600171	上海贝岭	46,300	804,694.00	0.20
188	002217	合力泰	152,600	801,150.00	0.20
189	600875	东方电气	90,200	798,270.00	0.20
190	000729	燕京啤酒	115,300	789,805.00	0.20
191	601966	玲珑轮胎	39,000	787,800.00	0.19
192	600021	上海电力	106,400	787,360.00	0.19
193	002831	裕同科技	28,600	786,786.00	0.19
194	000983	西山煤电	206,780	775,425.00	0.19
195	600094	大名城	130,200	774,690.00	0.19
196	603605	珀莱雅	4,300	774,086.00	0.19
197	600567	山鹰纸业	262,300	773,785.00	0.19
198	600862	中航高科	45,700	773,244.00	0.19
199	600881	亚泰集团	265,600	772,896.00	0.19
200	600060	海信视像	63,601	772,752.15	0.19
201	000877	天山股份	51,000	770,100.00	0.19
202	002399	海普瑞	30,600	766,224.00	0.19
203	600160	巨化股份	110,300	759,967.00	0.19
204	000060	中金岭南	203,300	756,276.00	0.19
205	600645	中源协和	26,700	754,275.00	0.19
206	002056	横店东磁	66,900	752,625.00	0.19
207	002709	天赐材料	22,040	744,731.60	0.18
208	603228	景旺电子	20,980	738,286.20	0.18
209	603712	七一二	19,203	737,011.14	0.18
210	600597	光明乳业	49,500	735,570.00	0.18
211	000090	天健集团	106,400	735,224.00	0.18
212	002458	益生股份	48,000	732,960.00	0.18
213	600026	中远海能	113,000	729,980.00	0.18
214	002429	兆驰股份	147,300	729,135.00	0.18
215	300133	华策影视	100,300	727,175.00	0.18
216	600754	锦江酒店	26,000	721,500.00	0.18
217	603568	伟明环保	31,030	719,896.00	0.18
218	600273	嘉化能源	81,800	714,932.00	0.18
219	600967	内蒙一机	68,700	713,793.00	0.18
220	600580	卧龙电驱	63,400	712,616.00	0.18
221	601005	重庆钢铁	478,100	712,369.00	0.18
222	002648	卫星石化	43,600	709,372.00	0.18
223	600392	盛和资源	100,300	707,115.00	0.17

224	002233	塔牌集团	58,700	706,161.00	0.17
225	000629	攀钢钒钛	350,900	705,309.00	0.17
226	600282	南钢股份	216,600	699,618.00	0.17
227	000960	锡业股份	81,500	697,640.00	0.17
228	002004	华邦健康	129,600	697,248.00	0.17
229	002807	江阴银行	177,200	696,396.00	0.17
230	600755	厦门国贸	105,100	693,660.00	0.17
231	002203	海亮股份	79,200	693,000.00	0.17
232	600039	四川路桥	180,900	691,038.00	0.17
233	002085	万丰奥威	106,400	689,472.00	0.17
234	600064	南京高科	70,700	687,204.00	0.17
235	000970	中科三环	69,700	681,666.00	0.17
236	600737	中粮糖业	87,338	679,489.64	0.17
237	600166	福田汽车	376,300	677,340.00	0.17
238	601118	海南橡胶	139,200	676,512.00	0.17
239	601975	招商南油	282,300	674,697.00	0.17
240	600566	济川药业	26,500	674,690.00	0.17
241	000778	新兴铸管	195,500	670,565.00	0.17
242	600195	中牧股份	41,300	670,299.00	0.17
243	300182	捷成股份	167,800	669,522.00	0.17
244	000690	宝新能源	141,800	669,296.00	0.17
245	000598	兴蓉环境	145,300	668,380.00	0.17
246	600563	法拉电子	10,800	667,440.00	0.17
247	300324	旋极信息	100,200	667,332.00	0.17
248	002110	三钢闽光	99,950	665,667.00	0.16
249	600466	蓝光发展	123,171	663,891.69	0.16
250	603816	顾家家居	14,700	661,647.00	0.16
251	600515	海航基础	126,900	659,880.00	0.16
252	600373	中文传媒	55,200	650,256.00	0.16
253	002506	协鑫集成	249,000	649,890.00	0.16
254	002183	怡亚通	120,800	647,488.00	0.16
255	300474	景嘉微	9,600	646,080.00	0.16
256	000402	金融街	97,280	645,939.20	0.16
257	000400	许继电气	48,800	644,160.00	0.16
258	000681	视觉中国	34,500	642,390.00	0.16
259	600435	北方导航	84,900	641,844.00	0.16
260	002745	木林森	41,577	640,701.57	0.16
261	002595	豪迈科技	32,900	640,234.00	0.16
262	000738	航发控制	46,900	640,185.00	0.16
263	002635	安洁科技	25,700	639,930.00	0.16
264	000089	深圳机场	83,500	639,610.00	0.16
265	002038	双鹭药业	49,900	639,219.00	0.16

266	002191	劲嘉股份	71,600	637,956.00	0.16
267	002925	盈趣科技	11,000	637,340.00	0.16
268	002092	中泰化学	140,300	635,559.00	0.16
269	000967	盈峰环境	76,800	633,600.00	0.16
270	600729	重庆百货	20,200	630,644.00	0.16
271	601106	中国一重	224,200	630,002.00	0.16
272	601860	紫金银行	148,800	629,424.00	0.16
273	000039	中集集团	86,940	628,576.20	0.16
274	002048	宁波华翔	40,700	628,408.00	0.16
275	600643	爱建集团	78,800	626,460.00	0.15
276	600808	马钢股份	242,600	625,908.00	0.15
277	000830	鲁西化工	83,900	625,894.00	0.15
278	601333	广深铁路	277,200	623,700.00	0.15
279	601098	中南传媒	58,700	621,046.00	0.15
280	600120	浙江东方	90,380	620,910.60	0.15
281	000930	中粮科技	90,800	620,164.00	0.15
282	600633	浙数文化	63,300	619,074.00	0.15
283	600056	中国医药	43,700	618,355.00	0.15
284	600258	首旅酒店	40,200	617,874.00	0.15
285	000825	太钢不锈	185,700	616,524.00	0.15
286	600376	首开股份	104,600	612,956.00	0.15
287	600649	城投控股	103,100	612,414.00	0.15
288	600388	龙净环保	69,500	611,600.00	0.15
289	600675	中华企业	149,100	606,837.00	0.15
290	000415	渤海租赁	200,600	597,788.00	0.15
291	000563	陕国投 A	160,900	596,939.00	0.15
292	601866	中远海发	323,900	595,976.00	0.15
293	300180	华峰超纤	69,600	595,776.00	0.15
294	002839	张家港行	103,400	595,584.00	0.15
295	002372	伟星新材	51,100	594,293.00	0.15
296	601718	际华集团	178,700	593,284.00	0.15
297	002407	多氟多	55,700	592,648.00	0.15
298	600776	东方通信	38,800	585,492.00	0.14
299	000501	鄂武商 A	37,300	584,864.00	0.14
300	002815	崇达技术	28,836	583,352.28	0.14
301	002640	跨境通	88,900	576,961.00	0.14
302	002064	华峰氨纶	113,600	575,952.00	0.14
303	600022	山东钢铁	445,800	575,082.00	0.14
304	002010	传化智联	105,600	574,464.00	0.14
305	000012	南玻 A	114,400	574,288.00	0.14
306	002583	海能达	75,500	573,045.00	0.14
307	603077	和邦生物	431,300	569,316.00	0.14

308	600500	中化国际	112,300	568,238.00	0.14
309	000078	海王生物	135,100	566,069.00	0.14
310	603486	科沃斯	18,700	564,927.00	0.14
311	600062	华润双鹤	42,700	564,494.00	0.14
312	601615	明阳智能	45,300	563,985.00	0.14
313	000932	华菱钢铁	149,400	563,238.00	0.14
314	000883	湖北能源	158,900	559,328.00	0.14
315	002375	亚厦股份	54,600	558,012.00	0.14
316	600266	城建发展	109,904	557,213.28	0.14
317	000807	云铝股份	127,500	555,900.00	0.14
318	000959	首钢股份	129,200	555,560.00	0.14
319	000685	中山公用	72,100	555,170.00	0.14
320	600316	洪都航空	34,700	548,260.00	0.14
321	000301	东方盛虹	98,400	547,104.00	0.14
322	601699	潞安环能	97,900	545,303.00	0.13
323	000028	国药一致	12,100	544,621.00	0.13
324	002936	郑州银行	158,280	544,483.20	0.13
325	000559	万向钱潮	112,100	542,564.00	0.13
326	000027	深圳能源	116,740	541,673.60	0.13
327	002155	湖南黄金	68,700	541,356.00	0.13
328	002244	滨江集团	126,700	541,009.00	0.13
329	601000	唐山港	240,700	536,761.00	0.13
330	000519	中兵红箭	56,900	535,998.00	0.13
331	000488	晨鸣纸业	108,400	535,496.00	0.13
332	600782	新钢股份	130,600	532,848.00	0.13
333	000528	柳工	84,300	531,933.00	0.13
334	000031	大悦城	104,300	530,887.00	0.13
335	000987	越秀金控	45,200	527,032.00	0.13
336	002444	巨星科技	44,000	522,720.00	0.13
337	600640	号百控股	25,899	516,685.05	0.13
338	002440	闰土股份	56,493	516,346.02	0.13
339	600908	无锡银行	105,000	515,550.00	0.13
340	002625	光启技术	70,200	508,950.00	0.13
341	002266	浙富控股	131,457	508,738.59	0.13
342	000156	华数传媒	46,900	507,927.00	0.13
343	600073	上海梅林	53,500	507,715.00	0.13
344	600777	新潮能源	331,600	504,032.00	0.12
345	601717	郑煤机	85,400	503,006.00	0.12
346	300459	金科文化	144,900	499,905.00	0.12
347	002390	信邦制药	108,500	494,760.00	0.12
348	300072	三聚环保	115,500	494,340.00	0.12
349	600312	平高电气	66,100	490,462.00	0.12

350	601958	金钼股份	78,700	486,366.00	0.12
351	601608	中信重工	141,900	485,298.00	0.12
352	002701	奥瑞金	115,100	482,269.00	0.12
353	600291	西水股份	53,100	480,555.00	0.12
354	600557	康缘药业	34,500	480,240.00	0.12
355	000898	鞍钢股份	195,500	478,975.00	0.12
356	002424	贵州百灵	57,700	478,910.00	0.12
357	000046	泛海控股	126,800	478,036.00	0.12
358	002434	万里扬	54,800	475,664.00	0.12
359	000887	中鼎股份	59,900	470,215.00	0.12
360	600409	三友化工	100,800	469,728.00	0.12
361	000758	中色股份	112,200	468,996.00	0.12
362	600138	中青旅	47,500	468,825.00	0.12
363	002505	大康农业	208,200	468,450.00	0.12
364	600765	中航重机	45,800	468,076.00	0.12
365	000008	神州高铁	158,500	465,990.00	0.12
366	600863	内蒙华电	188,700	464,202.00	0.11
367	002563	森马服饰	65,800	463,890.00	0.11
368	002589	瑞康医药	85,900	460,424.00	0.11
369	601228	广州港	150,800	458,432.00	0.11
370	002002	鸿达兴业	126,900	458,109.00	0.11
371	600751	海航科技	145,900	456,667.00	0.11
372	600507	方大特钢	87,921	456,309.99	0.11
373	000813	德展健康	73,500	455,700.00	0.11
374	000712	锦龙股份	36,300	453,750.00	0.11
375	600158	中体产业	55,200	451,536.00	0.11
376	600970	中材国际	85,400	450,912.00	0.11
377	600259	广晟有色	14,800	444,000.00	0.11
378	600835	上海机电	26,200	443,566.00	0.11
379	600478	科力远	94,000	442,740.00	0.11
380	600639	浦东金桥	27,669	442,150.62	0.11
381	601200	上海环境	36,830	441,960.00	0.11
382	600545	卓郎智能	92,816	439,019.68	0.11
383	300134	大富科技	31,400	438,972.00	0.11
384	603885	吉祥航空	47,900	435,890.00	0.11
385	600717	天津港	98,548	435,582.16	0.11
386	600648	外高桥	30,800	435,512.00	0.11
387	603198	迎驾贡酒	20,000	435,400.00	0.11
388	000826	启迪环境	58,600	434,812.00	0.11
389	601880	大连港	252,600	434,472.00	0.11
390	002503	搜于特	151,400	425,434.00	0.11
391	002249	大洋电机	116,100	419,121.00	0.10

392	601928	凤凰传媒	61,600	418,880.00	0.10
393	600125	铁龙物流	74,600	416,268.00	0.10
394	002901	大博医疗	3,480	415,129.20	0.10
395	601598	中国外运	128,400	414,732.00	0.10
396	000732	泰禾集团	81,100	412,799.00	0.10
397	600348	阳泉煤业	97,785	412,652.70	0.10
398	000061	农产品	55,500	411,255.00	0.10
399	600823	世茂股份	91,100	407,217.00	0.10
400	002665	首航高科	165,400	403,576.00	0.10
401	600329	中新药业	23,189	401,633.48	0.10
402	002867	周大生	18,100	401,277.00	0.10
403	601611	中国核建	64,200	396,756.00	0.10
404	002302	西部建设	41,300	396,480.00	0.10
405	600582	天地科技	135,200	396,136.00	0.10
406	603377	东方时尚	23,800	394,128.00	0.10
407	000990	诚志股份	31,000	393,390.00	0.10
408	600307	酒钢宏兴	254,500	391,930.00	0.10
409	300376	易事特	75,200	391,040.00	0.10
410	600748	上实发展	75,290	384,731.90	0.10
411	600901	江苏租赁	73,700	383,977.00	0.09
412	603888	新华网	17,100	382,356.00	0.09
413	000718	苏宁环球	123,500	381,615.00	0.09
414	600664	哈药股份	122,800	378,224.00	0.09
415	600141	兴发集团	42,000	375,900.00	0.09
416	601678	滨化股份	88,600	375,664.00	0.09
417	600017	日照港	150,500	374,745.00	0.09
418	000717	韶钢松山	98,200	373,160.00	0.09
419	002544	杰赛科技	28,200	370,830.00	0.09
420	000062	深圳华强	25,500	370,770.00	0.09
421	002419	天虹股份	38,818	370,711.90	0.09
422	000869	张裕A	10,800	368,820.00	0.09
423	000543	皖能电力	91,600	368,232.00	0.09
424	300257	开山股份	28,100	367,267.00	0.09
425	002128	露天煤业	47,300	366,575.00	0.09
426	000848	承德露露	52,260	365,820.00	0.09
427	600277	亿利洁能	111,692	364,115.92	0.09
428	002093	国脉科技	40,900	361,965.00	0.09
429	600869	智慧能源	90,300	361,200.00	0.09
430	002416	爱施德	50,100	359,718.00	0.09
431	002408	齐翔腾达	57,900	359,559.00	0.09
432	002653	海思科	13,000	345,930.00	0.09
433	603328	依顿电子	33,000	344,190.00	0.09



434	002948	青岛银行	67,200	342,048.00	0.08
435	300197	铁汉生态	134,200	340,868.00	0.08
436	603983	丸美股份	3,900	335,517.00	0.08
437	603650	彤程新材	14,400	335,088.00	0.08
438	000537	广宇发展	45,900	335,070.00	0.08
439	000553	安道麦 A	37,025	333,965.50	0.08
440	603515	欧普照明	12,200	333,914.00	0.08
441	600565	迪马股份	118,200	329,778.00	0.08
442	603766	隆鑫通用	83,600	323,532.00	0.08
443	600787	中储股份	72,200	316,958.00	0.08
444	002491	通鼎互联	61,800	316,416.00	0.08
445	601019	山东出版	50,500	315,625.00	0.08
446	603056	德邦股份	23,100	312,543.00	0.08
447	600350	山东高速	50,700	311,298.00	0.08
448	600339	中油工程	136,300	309,401.00	0.08
449	601139	深圳燃气	47,300	307,450.00	0.08
450	600770	综艺股份	63,100	302,880.00	0.07
451	002470	*ST 金正	132,800	301,456.00	0.07
452	600338	西藏珠峰	30,100	301,000.00	0.07
453	601869	长飞光纤	9,719	299,442.39	0.07
454	000600	建投能源	58,400	297,256.00	0.07
455	600053	九鼎投资	9,900	295,416.00	0.07
456	002051	中工国际	40,175	292,474.00	0.07
457	601016	节能风电	136,000	288,320.00	0.07
458	603786	科博达	3,800	286,330.00	0.07
459	600657	信达地产	69,300	285,516.00	0.07
460	600694	大商股份	11,900	285,481.00	0.07
461	002285	世联行	100,100	279,279.00	0.07
462	002118	紫鑫药业	62,800	278,832.00	0.07
463	600985	淮北矿业	35,100	273,429.00	0.07
464	600428	中远海特	87,700	270,116.00	0.07
465	601801	皖新传媒	48,500	269,660.00	0.07
466	600707	彩虹股份	58,600	267,216.00	0.07
467	603317	天味食品	4,785	265,950.30	0.07
468	600575	淮河能源	126,400	264,176.00	0.07
469	000937	冀中能源	86,800	262,136.00	0.06
470	600006	东风汽车	65,000	261,950.00	0.06
471	601865	福莱特	13,400	251,920.00	0.06
472	600757	长江传媒	48,900	248,901.00	0.06
473	600996	贵广网络	34,100	243,133.00	0.06
474	600623	华谊集团	45,835	236,508.60	0.06
475	603556	海兴电力	16,230	234,361.20	0.06

476	600874	创业环保	35,200	233,728.00	0.06
477	002941	新疆交建	16,000	226,400.00	0.06
478	600058	五矿发展	35,200	212,608.00	0.05
479	603868	飞科电器	4,100	202,253.00	0.05
480	000785	居然之家	24,200	191,664.00	0.05
481	601003	柳钢股份	41,900	185,617.00	0.05
482	600903	贵州燃气	18,800	184,992.00	0.05
483	002946	新乳业	10,200	176,970.00	0.04
484	000025	特力A	9,400	172,302.00	0.04
485	601127	小康股份	20,600	171,186.00	0.04
486	600335	国机汽车	35,600	164,472.00	0.04
487	601969	海南矿业	32,100	156,648.00	0.04
488	601512	中新集团	13,600	156,400.00	0.04
489	002818	富森美	12,220	150,306.00	0.04
490	603355	莱克电气	6,000	149,340.00	0.04
491	603379	三美股份	6,500	139,555.00	0.03
492	603225	新凤鸣	13,600	135,728.00	0.03
493	002423	中粮资本	14,900	129,630.00	0.03
494	601811	新华文轩	12,700	129,159.00	0.03
495	001872	招商港口	8,202	119,339.10	0.03
496	600917	重庆燃气	15,500	110,670.00	0.03
497	603025	大豪科技	15,100	109,777.00	0.03
498	601068	中铝国际	24,800	96,968.00	0.02
499	603256	宏和科技	7,600	86,944.00	0.02
500	002957	科瑞技术	3,600	86,040.00	0.02

### 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

无。

## 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	002821	凯莱英	4,161,205.64	0.38
2	300088	长信科技	4,055,981.12	0.37
3	300014	亿纬锂能	3,811,667.77	0.35
4	002384	东山精密	3,498,749.00	0.32
5	300253	卫宁健康	3,422,456.00	0.31
6	002049	紫光国微	3,413,482.54	0.31
7	002439	启明星辰	3,327,758.05	0.30
8	002185	华天科技	3,058,938.00	0.28
9	603444	吉比特	3,056,957.00	0.28

10	002463	沪电股份	3,044,503.00	0.28
11	002129	中环股份	3,015,669.66	0.27
12	300383	光环新网	3,014,073.00	0.27
13	002131	利欧股份	2,798,100.00	0.25
14	002371	北方华创	2,792,188.00	0.25
15	000066	中国长城	2,790,925.00	0.25
16	002065	东华软件	2,762,057.88	0.25
17	000750	国海证券	2,593,245.20	0.24
18	300012	华测检测	2,547,229.00	0.23
19	002340	格林美	2,541,482.00	0.23
20	002223	鱼跃医疗	2,528,236.08	0.23

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	300014	亿纬锂能	11,665,589.20	1.06
2	002384	东山精密	11,243,058.49	1.02
3	002371	北方华创	10,491,278.43	0.96
4	002463	沪电股份	10,451,757.47	0.95
5	002129	中环股份	9,875,486.56	0.90
6	002049	紫光国微	9,723,278.78	0.89
7	300383	光环新网	9,441,182.86	0.86
8	000066	中国长城	9,211,589.00	0.84
9	002065	东华软件	8,286,428.59	0.75
10	002812	恩捷股份	7,915,961.02	0.72
11	002821	凯莱英	7,881,130.00	0.72
12	300253	卫宁健康	7,663,767.80	0.70
13	002439	启明星辰	7,273,835.01	0.66
14	300088	长信科技	6,914,978.00	0.63
15	300529	健帆生物	6,890,164.14	0.63
16	002127	南极电商	6,339,329.38	0.58
17	002180	纳思达	6,324,702.00	0.58
18	002465	海格通信	6,322,084.00	0.58
19	002340	格林美	6,122,805.10	0.56
20	300012	华测检测	6,101,394.30	0.56

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	382,606,750.17
卖出股票收入（成交）总额	779,236,061.95

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

#### 1、南极电商

本报告期，本基金持有南极电商，其持有南极电商股份有限公司（以下简称“南极电商”或“公司”）134,049,616 股，占公司总股本的 5.46%，为公司 5%以上大股东。南极电商于 2019 年 9 月 17 日披露减持计划，其通过集中竞价方式、大宗交易方式减持南极电商股份不超过 2450 万股，其中集中竞价减持将于公告披露起 15 个交易日后进行。9 月 26 日，通过集中竞价方式减持南极电商股份 82 万股，减持金额 903.28 万元，减持数量占南极电商总股本比例为 0.033%。前述减持行为距离减持计划披露日未满 15 个交易日。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第四十六条、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》第八条的规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，被采取出具警示函的监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

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	229,850.65
2	应收证券清算款	541,007.58
3	应收股利	-
4	应收利息	1,076.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	771,934.59

### 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

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

## 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 (%)
2,266	30,441.03	64,105,656.00	92.93	4,873,723.00	7.07

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“工银瑞信沪深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 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—工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金	27,620,000.00	40.04

## 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	41.00
2	广发证券股份有限公司	2,239,128.00	3.25
3	中信证券股份有限公司	2,115,070.00	3.07
4	中国银河证券股份有限公司	1,910,538.00	2.77
5	工银瑞信添福混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	806,847.00	1.17
6	华泰证券股份有限公司	703,197.00	1.02
7	申万宏源证券有限公司	407,639.00	0.59

8	韩敏	122,956.00	0.18
9	邹绍英	115,996.00	0.17
10	梁华明	114,963.00	0.17
11	中国银行股份有限公司—工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金	27,620,000.00	40.04

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

无。

## § 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	208,979,379.00
本报告期基金总申购份额	92,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	232,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	68,979,379.00

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：

基金管理人于 2020 年 2 月 22 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，马成先生自 2020 年 2 月 21 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内基金投资策略未有改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	941,256,848.76	81.08%	575,398.26	79.58%	-
银河证券	2	112,009,161.98	9.65%	81,808.87	11.31%	-
中金公司	1	80,742,407.48	6.96%	49,358.88	6.83%	-
招商证券	1	26,908,383.04	2.32%	16,448.99	2.28%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-



光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

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

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

构，租用其交易单元。

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 3 日

	投资基金上市交易提示性公告		
2	关于工银瑞信基金管理有限公司调整旗下部分 ETF 基金结算模式的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 15 日
3	关于工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金结算模式调整并相应修改托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 15 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金春节假期延长期间交易规则的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 29 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 2 月 22 日
6	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分 ETF 调整指数使用费的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 13 日
7	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增扩位证券简称的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 16 日
8	关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 25 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 26 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于终止中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 26 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 11 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	20200108-20200630	28,282,724.00	-	-	28,282,724.00	41.00
	2	20200227-20200630	-	56,420,000.00	28,800,000.00	27,620,000.00	40.04

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。						

## 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

2020 年 8 月 28 日