

工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指
数证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
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	55
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
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
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	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	半导体龙头 ETF
场内简称	半导体龙头 ETF
基金主代码	159665
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 12 月 22 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	552,576,860.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 1 月 6 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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	国证半导体芯片指数收益率。
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	招商证券股份有限公司
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	95565
传真	010-66583158	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	100033	518000

法定代表人	赵桂才	霍达
-------	-----	----

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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	50,087,607.76
本期利润	41,013,691.24
加权平均基金份额本期利润	0.1441
本期加权平均净值利润率	13.53%
本期基金份额净值增长率	4.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,413,688.63
期末可供分配基金份额利润	0.0460
期末基金资产净值	577,990,548.63
期末基金份额净值	1.0460
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.60%

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

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

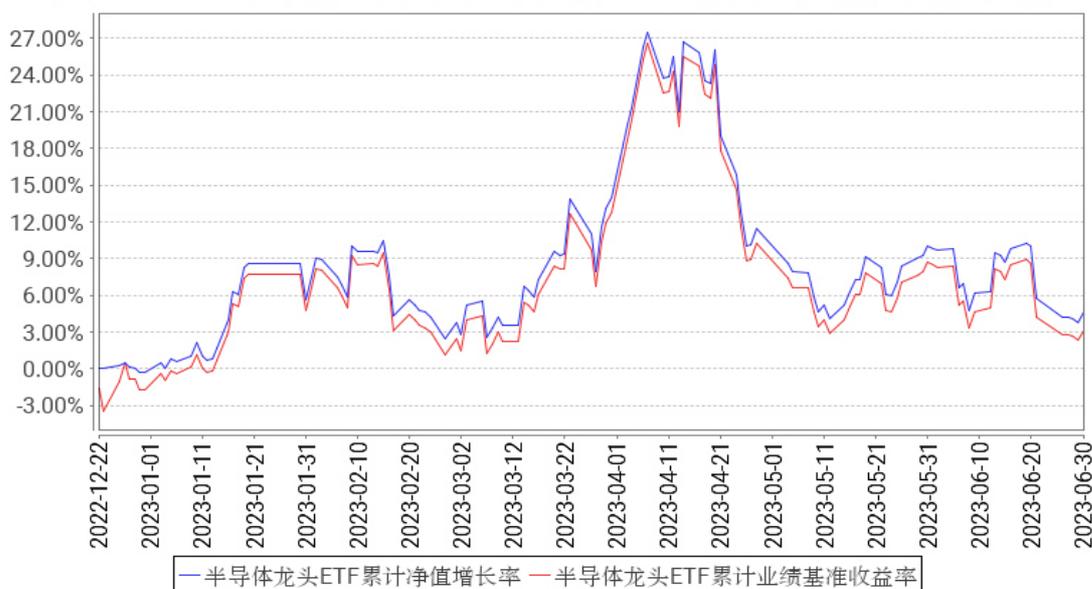
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.97%	1.48%	-5.13%	1.51%	0.16%	-0.03%

过去三个月	-8.22%	1.95%	-8.51%	1.99%	0.29%	-0.04%
过去六个月	4.91%	1.78%	4.90%	1.83%	0.01%	-0.05%
自基金合同生效起至今	4.60%	1.73%	3.15%	1.81%	1.45%	-0.08%

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

半导体龙头ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2022 年 12 月 22 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效未满 1 年。

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是由中国工商银行绝对控股、独立运营的基金公司，工商银行拥有 80% 股权，瑞士信贷拥有 20% 股权。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 2005 年 6 月成立以来，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。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、公募基金投顾等多项业务资格，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，为逾 8500 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 2023 年 6 月 30 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 238 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模超过 1.7 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		
史宝琰	本基金的基金经理	2022 年 12 月 22 日	-	8 年	硕士研究生。曾任 Amazon Inc. 数据分析工程师，华夏基金高级经理；2019 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2021 年 12 月 1 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 3 月 21 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；2022 年 3 月 21 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；2022 年 12 月 22 日至今，担任工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 1 月 4 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 1 月 4 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2023 年 2 月 17

					日至今，担任工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 3 月 30 日至今，担任工银瑞信中证港股通高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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《基金从业人员资格管理规则》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未发生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。

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

经济增长方面，在政策支持和疫后经济活动自然恢复两股动力带动下，一季度经济持续修复：制造业 PMI 重返荣枯线以上，由去年四季度的 48.1%升至 51.3%，并且 2、3 两月连续超预期。步入二季度，实体经济增长修复不及预期，价格指数同比回落：4-6 月制造业 PMI 持续低于 50%荣枯

线，显示制造业处于收缩状态；服务业 PMI 虽仍处于荣枯线以上，但环比持续回落，显示服务业修复斜率放缓。通货膨胀角度，一季度物价水平较为疲软，1-2 月 CPI 同比增速为 1.5%，二季度物价水平延续疲软，4-5 月 CPI 同比增速均低于 0.2%，4-5 月 PPI 同比增速均值为-4.1%，两者均处于历史较低分位数。总结而言，上半年经济修复疲弱，从直接原因上来看，地产和外需不振是主要原因，企业、居民、财政仍然难以形成收入及就业改善-预期改善-投资消费改善的正向循环。

流动性方面，整体上半年增量资金有限，一季度宏观流动性维持充裕，而进入二季度，社融数据较为疲弱，A 股资金面增量资金减少。宏观流动性方面，银行间市场流动性整体维持宽松，DR007 中枢较一季度回落、围绕政策利率中枢波动。社融方面，二季度社融及信贷表现疲弱，4-5 月新增社融分别较前 5 年同期均值缩减 38%、28%，新增信贷分别较前 5 年同期均值缩减 58%、14%，M2 同比增速下降。A 股资金面方面，由于市场赚钱效应较差，二季度新增资金相比一季度进一步减少，市场存量博弈的特征更加明显。一季度增量较明显的北上和两融资金流入均放缓，科创主题相关的 ETF 成为二季度主要的增量资金。

股市方面，上半年 A 股整体呈现前高后低，TMT 行业涨幅靠前。上半年 A 股市场宽幅震荡，一季度各类主题板块表现亮眼，以数字经济、中特估、AI 为代表的相关板块涨幅居前，顺周期及新能源板块承压。进入二季度，市场整体表现平淡，行业之间快速切换轮动，“高低切换”的现象较为显著，赚钱效应较差。回顾上半年 A 股市场表现，主要宽基指数涨跌不一，小盘风格相对较好，其中上证综指上涨 3.7%，沪深 300 指数下跌 0.8%，深证成指上涨 0.1%。从风格来看，代表大盘股的中证 100 指数和代表中盘指数的中证 200 回报分别为-1.8%和 4.1%，中小板指和创业板指回报分别为-1.8%和-5.6%。分行业来看，各行业涨跌幅分化较大，通信、传媒、计算机表现排名前三，收益率分别为 45.4%、43.4%和 32.3%，消费者服务、房地产、农林牧渔回报列最后三位，分别为-27.9%、-14.1%和-9.2%。

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 建仓期仓位变动等因素的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 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 4.91%，业绩比较基准收益率为 4.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年的关键在于国内经济复苏的力度及海外流动性的改善，年初的时候我们判断国内经济弱复苏，海外衰退，从实际情况看国内的复苏略不及预期，企业盈利承压。站到当前时点展望下半年，我们认为市场整体机会大于风险，多数板块估值水平处于历史相对低位，且盈利能力展望下半年及明年能看到改善的趋势。此外，海外主要经济体加息进入尾声，资本市场流动

性有望进一步提升，存在戴维斯双击的可能，需要自上而下挖掘结构性机会。

展望下半年投资策略，我们认为在增量资金相对有限的市场环境下，同时叠加政策刺激较弱、海外利率维持在高位，很难形成牛市 beta 行情，更多聚焦在结构层面。行业配置上，我们认为 chatGPT 等 AI 大模型带来的产业变革，对应的 AI 数字经济 TMT 行情，在未来的 2-3 年周期持续看好，我们认为大模型将持续进化，通过供给创造需求，将不断带来新的投资机会。但短期来看，第一波普涨行情已经过去，后续应聚焦业绩兑现能力更强的细分领域。此外，随着国内经济政策的陆续落地，我们认为消费、地产链相关的板块可能有阶段性交易机会。短期来看，下半年大盘指数存在迎来反弹的概率，当下 TMT+顺周期困境反转的配置可能是较好的选择。

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，原则上为运作部、投研部门（研究部或固定收益部）、风险管理部、法律合规部的部门负责人构成，组长由运作部负责人担任。

如遇相关部门负责人无法参与小组会议的情况，由其指定相关人员代为履行职责。

（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

投资经理可发起并参与所管理组合持仓证券的风险事件的估值讨论，但不得参与决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,968,969.77	95,898,475.74
结算备付金		659,797.33	460,141,916.68
存出保证金		1,756,449.06	-
交易性金融资产	6.4.7.2	574,519,882.18	611,931,037.50
其中：股票投资		574,519,882.18	611,931,037.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		4,527,196.78	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	-
资产总计		596,507,911.36	1,167,971,429.92
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	93,050,718.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		121,607.17	119,653.66
应付托管费		18,916.67	18,612.79
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	18,376,838.89	399,951.86
负债合计		18,517,362.73	93,588,936.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	552,576,860.00	1,077,576,860.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,413,688.63	-3,194,366.39
净资产合计		577,990,548.63	1,074,382,493.61
负债和净资产总计		596,507,911.36	1,167,971,429.92

注：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 22 日。

2、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0460 元，基金份额总额为 552,576,860.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		41,983,021.27
1. 利息收入		242,427.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	242,427.89
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）		45,547,650.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	45,036,521.29
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	511,129.67
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	6.4.7.20	-9,073,916.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,266,858.94
减：二、营业总支出		969,330.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	679,953.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	105,770.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	183,605.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		41,013,691.24
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,013,691.24
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		41,013,691.24

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,077,576,860.00	-	-3,194,366.39	1,074,382,493.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,077,576,860.00	-	-3,194,366.39	1,074,382,493.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-525,000,000.00	-	28,608,055.02	-496,391,944.98
（一）、综合收益总额	-	-	41,013,691.24	41,013,691.24
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-525,000,000.00	-	-12,405,636.22	-537,405,636.22
其中：1. 基金申购款	579,000,000.00	-	45,395,359.67	624,395,359.67
2. 基金赎回款	-1,104,000,000.00	-	-57,800,995.89	-1,161,800,995.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	552,576,860.00	-	25,413,688.63	577,990,548.63

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：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2022]2177号《关于准予工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于2022年11月23日至2022年12月16日向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2022）验字第60802052_A29号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2022年12月22日正式生效，设立时募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币1,077,511,675.00元，折合1,077,511,675.00份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币70,613.92元，其中人民币65,185.00元折合65,185.00份基金份额，剩余人民币5,428.92元归入基金财产；以上收到的实收基金共计人民币1,077,576,860.00元，折合1,077,576,860.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

公允价值变动计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具

体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配采用现金分红方式；

(3) 基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率；

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

(5) 基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告，无需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

(3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征

收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	14,968,969.77
等于：本金	14,959,593.84
加：应计利息	9,375.93
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	14,968,969.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	586,619,182.55	-	574,519,882.18	-12,099,300.37

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	586,619,182.55	-	574,519,882.18	-12,099,300.37

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	392,212.27
其中：交易所市场	392,212.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	59,507.37
应退替代款	17,865,863.23
可退替代款	9,941.40
IOPV 服务费	9,643.04
合计	18,376,838.89

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,077,576,860.00	1,077,576,860.00
本期申购	579,000,000.00	579,000,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-1,104,000,000.00	-1,104,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	552,576,860.00	552,576,860.00

注：1、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。

2、本基金合同于 2022 年 12 月 22 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,077,576,860.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 65,185.00 份基金份额。

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	-168,982.54	-3,025,383.85	-3,194,366.39
本期利润	50,087,607.76	-9,073,916.52	41,013,691.24
本期基金份额交易产生的变动数	68,819,432.60	-81,225,068.82	-12,405,636.22
其中：基金申购款	112,639,615.12	-67,244,255.45	45,395,359.67
基金赎回款	-43,820,182.52	-13,980,813.37	-57,800,995.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	118,738,057.82	-93,324,369.19	25,413,688.63

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	161,606.28
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	70,410.53
其他	10,411.08
合计	242,427.89

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,779,795.27
股票投资收益——赎回差价收入	9,256,726.02

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	45,036,521.29

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	837,563,715.08
减：卖出股票成本总额	799,563,106.63
减：交易费用	2,220,813.18
买卖股票差价收入	35,779,795.27

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,161,800,995.89
减：现金支付赎回款总额	744,236,196.89
减：赎回股票成本总额	408,308,072.98
减：交易费用	-
赎回差价收入	9,256,726.02

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	511,129.67
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	511,129.67

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,073,916.52
股票投资	-9,073,916.52
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,073,916.52

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	5,266,858.94
合计	5,266,858.94

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	9,643.04
开户费	400.00
注册登记费	74,383.76
合计	183,605.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
招商证券股份有限公司	1,803,583,559.83	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券股份有限 公司	1,238,843.18	100.00	392,212.27	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中登结收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	679,953.69
其中：支付销售机构的客户维护费	140,314.06

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
	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	105,770.59

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 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
招商证券股份 有限公司	5,342,870.00	0.97	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	14,968,969.77	161,606.28

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
688502	茂莱 光学	2023年 2月28 日	6个月	新股锁 定	69.72	178.59	789	55,009.08	140,907.51	-
301395	仁信 新材	2023年 6月21 日	1个月 内(含)	新股未 上市	26.68	26.68	3,740	99,783.20	99,783.20	-
301486	致尚	2023年	1个月	新股未	57.66	57.66	1,656	95,484.96	95,484.96	-

	科技	6月30日	内(含)	上市							
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	4,472	89,395.28	89,395.28		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,220	67,100.00	67,100.00		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,547	57,084.30	57,084.30		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,060	53,189.20	53,189.20		-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	523	12,431.71	22,431.47		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	975	19,363.50	17,608.50		-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	529	20,038.52	15,600.21		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	828	9,190.80	14,109.12		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	183	5,416.80	13,069.86		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	304	8,128.96	12,366.72		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	416	11,098.88	11,098.88		-

688361	中科 飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定	23.60	64.67	170	4,012.00	10,993.90	-
301291	明阳 电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定	38.13	31.03	349	13,307.37	10,829.47	-
688469	中芯 集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定	5.69	5.41	2,001	11,385.69	10,825.41	-
301315	威士 顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	32.29	51.12	210	6,780.90	10,735.20	-
301486	致尚 科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定	57.66	57.66	184	10,609.44	10,609.44	-
688543	国科 军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定	43.67	53.05	195	8,515.65	10,344.75	-
688620	安凯 微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定	10.68	12.34	827	8,832.36	10,205.18	-
301310	鑫宏 业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁 定	67.28	65.43	154	10,361.12	10,076.22	-
301303	真兰 仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股锁 定	26.80	22.32	450	12,060.00	10,044.00	-
301292	海科 新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定	19.99	19.99	497	9,935.03	9,935.03	-
301325	曼恩 斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定	76.80	107.95	91	6,988.80	9,823.45	-
301210	金杨 股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定	57.88	49.17	192	11,112.96	9,440.64	-
688576	西山 科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定	135.80	120.41	75	10,185.00	9,030.75	-
301373	凌玮 科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301408	华人 健康	2023 年 2 月 22	6 个月	新股锁 定	16.24	16.95	490	7,957.60	8,305.50	-

		日									
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	190	7,828.00	8,111.10		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	226	10,432.16	8,072.72		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	360	4,564.80	8,031.60		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	532	5,947.76	7,761.88		-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05		-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	188	10,014.76	7,557.60		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	136	7,480.00	7,480.00		-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	291	8,794.02	7,420.50		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	222	7,916.52	7,383.72		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	289	5,548.80	7,378.17		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	308	6,732.88	7,345.80		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	193	7,718.07	7,085.03		-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	137	6,026.63	7,065.09		-
301387	光大	2023年	6个月	新股锁	58.32	45.36	154	8,981.28	6,985.44		-

	同创	4月10日		定							
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	224	11,200.00	6,879.04		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	304	7,496.64	6,843.04		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	419	5,933.04	6,791.99		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	194	6,596.00	6,776.42		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	132	4,620.00	6,762.36		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	203	4,831.40	6,666.52		-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	316	9,085.00	6,642.32		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	71	5,103.48	6,574.60		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	71	5,325.00	6,443.96		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	215	5,435.20	6,422.05		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	172	6,346.80	6,346.80		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	197	6,370.98	6,276.42		-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	520	6,292.00	6,276.40		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	159	5,747.85	6,062.67		-

688552	航天南湖	2023年 5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	253	5,356.01	5,945.50	-
301202	朗威股份	2023年 6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	229	5,912.78	5,912.78	-
301232	飞沃科技	2023年 6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	99	7,177.50	5,783.58	-
301355	南王科技	2023年 6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	334	5,861.70	5,594.50	-
001287	中电港	2023年 3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	265	3,148.20	5,570.30	-
301386	未来电器	2023年 3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	230	6,897.70	5,471.70	-
688512	慧智微	2023年 5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	282	5,899.44	5,403.12	-
688570	天玛智控	2023年 5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	212	6,415.12	5,369.96	-
301332	德尔玛	2023年 5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	387	5,731.47	5,313.51	-
688623	双元科技	2023年 5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	60	7,552.80	5,207.40	-
301157	华塑科技	2023年 3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	96	5,424.00	5,081.28	-
301357	北方长龙	2023年 4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	105	5,250.00	5,080.95	-
688581	安杰思	2023年 5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	43	5,409.40	5,075.29	-
301281	科源制药	2023年 3月28日	6个月	新股锁定	31.59	25.10	200	6,317.74	5,020.00	-
301203	国泰环保	2023年 3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	142	6,550.46	4,884.80	-

		日									
301323	新莱福	2023年 5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	123	4,804.38	4,841.28	-	
301439	泓淋电力	2023年 3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	282	5,637.18	4,765.80	-	
688433	华曙高科	2023年 4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	149	3,972.34	4,693.50	-	
601061	中信金属	2023年 3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	586	3,855.88	4,441.88	-	
301337	亚华电子	2023年 5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	142	4,629.20	4,312.54	-	
603135	中重科技	2023年 3月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	210	3,738.00	3,756.90	-	
301345	涛涛车业	2023年 3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	77	5,655.65	3,591.28	-	
688479	友车科技	2023年 5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	119	4,044.81	3,509.31	-	
001380	华纬科技	2023年 5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	112	3,230.08	3,447.36	-	
601133	柏诚股份	2023年 3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	199	2,320.34	2,439.74	-	
601065	江盐集团	2023年 3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	206	2,134.16	2,439.04	-	
603137	恒尚节能	2023年 4月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	136	2,162.40	2,324.24	-	
001328	登康口腔	2023年 3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	84	1,737.12	2,141.16	-	
001282	三联锻造	2023年 5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	60	1,675.80	1,981.80	-	
001324	长青	2023年	6个月	新股锁	18.88	19.60	93	1,755.84	1,822.80	-	

	科技	5月12日		定							
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	112	1,632.96	1,806.56	-	
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	66	1,714.68	1,618.98	-	
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	107	1,645.66	1,591.09	-	
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	39	1,734.72	1,539.72	-	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,968,969.77	-	-	-	14,968,969.77
结算备付金	659,797.33	-	-	-	659,797.33
存出保证金	1,756,449.06	-	-	-	1,756,449.06
交易性金融资产	-	-	-	-574,519,882.18	574,519,882.18
应收清算款	-	-	-	4,527,196.78	4,527,196.78
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	17,385,216.16	-	-	-579,122,695.20	596,507,911.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	121,607.17	121,607.17
应付托管费	-	-	-	18,916.67	18,916.67
其他负债	-	-	-	18,376,838.89	18,376,838.89
负债总计	-	-	-	18,517,362.73	18,517,362.73
利率敏感度缺口	17,385,216.16	-	-	-560,605,332.47	577,990,548.63
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	95,898,475.74	-	-	-	95,898,475.74
结算备付金	460,141,916.68	-	-	-	460,141,916.68

交易性金融资产	-	-	-611,931,037.50	611,931,037.50
资产总计	556,040,392.42	-	-611,931,037.50	1,167,971,429.92
负债				
应付清算款	-	-	-93,050,718.00	93,050,718.00
应付管理人报酬	-	-	-119,653.66	119,653.66
应付托管费	-	-	-18,612.79	18,612.79
其他负债	-	-	-399,951.86	399,951.86
负债总计	-	-	-93,588,936.31	93,588,936.31
利率敏感度缺口	556,040,392.42	-	-518,342,101.19	1,074,382,493.61

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

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 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	574,519,882.18	99.40	611,931,037.50	56.96
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	574,519,882.18	99.40	611,931,037.50	56.96

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	28,154,017.48	5,261,077.28
	业绩比较基准减少 5%	-28,154,017.48	-5,261,077.28

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	573,255,122.73	611,931,037.50

第二层次	513,419.87	-
第三层次	751,339.58	-
合计	574,519,882.18	611,931,037.50

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股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	574,519,882.18	96.31
	其中：股票	574,519,882.18	96.31
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	15,628,767.10	2.62
8	其他各项资产	6,359,262.08	1.07

9	合计	596,507,911.36	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	527,049,926.41	91.19
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	-	-
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	46,205,196.32	7.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	573,255,122.73	99.18

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	1,127,542.91	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	4,763.98	0.00
F	批发和零售业	25,160.72	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	47,097.72	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,791.99	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	4,884.80	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	13,069.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,264,759.45	0.22

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	688981	中芯国际	1,031,219	52,097,183.88	9.01
2	002371	北方华创	143,726	45,654,563.90	7.90
3	603501	韦尔股份	407,130	39,915,025.20	6.91
4	688012	中微公司	231,066	36,150,275.70	6.25
5	603986	兆易创新	334,344	35,524,050.00	6.15
6	002049	紫光国微	354,080	33,017,960.00	5.71
7	688008	澜起科技	449,868	25,831,420.56	4.47
8	300316	晶盛机电	332,200	23,552,980.00	4.07
9	600584	长电科技	740,500	23,081,385.00	3.99

10	600745	闻泰科技	466,104	22,792,485.60	3.94
11	600703	三安光电	1,313,660	22,647,498.40	3.92
12	688256	寒武纪	100,624	18,917,312.00	3.27
13	300782	卓胜微	182,360	17,621,446.80	3.05
14	688126	沪硅产业	765,054	15,989,628.60	2.77
15	300223	北京君正	158,604	14,006,319.24	2.42
16	688099	晶晨股份	163,001	13,744,244.32	2.38
17	600460	士兰微	449,180	13,596,678.60	2.35
18	300661	圣邦股份	163,480	13,426,612.40	2.32
19	688396	华润微	248,746	13,036,777.86	2.26
20	002156	通富微电	574,345	12,980,197.00	2.25
21	002185	华天科技	1,409,500	12,967,400.00	2.24
22	300474	景嘉微	121,072	10,895,269.28	1.89
23	605358	立昂微	283,047	10,396,316.31	1.80
24	603290	斯达半导	43,600	9,382,720.00	1.62
25	688536	思瑞浦	37,108	8,089,544.00	1.40
26	688385	复旦微电	134,050	6,715,905.00	1.16
27	603893	瑞芯微	91,804	6,687,921.40	1.16
28	301269	华大九天	44,400	5,454,096.00	0.94
29	688082	盛美上海	42,180	4,656,672.00	0.81
30	688728	格科微	279,724	4,425,233.68	0.77

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	688502	茂莱光学	789	140,907.51	0.02
2	301395	仁信新材	4,156	110,882.08	0.02
3	301486	致尚科技	1,840	106,094.40	0.02
4	301292	海科新源	4,969	99,330.31	0.02
5	688603	天承科技	1,356	74,580.00	0.01
6	301261	恒工精密	1,719	63,431.10	0.01
7	301202	朗威股份	2,289	59,101.98	0.01
8	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
9	301358	湖南裕能	523	22,431.47	0.00
10	688249	晶合集成	975	17,608.50	0.00
11	688443	智翔金泰	529	15,600.21	0.00
12	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
13	688472	阿特斯	828	14,109.12	0.00
14	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
15	301293	三博脑科	183	13,069.86	0.00
16	688582	芯动联科	304	12,366.72	0.00
17	688361	中科飞测	170	10,993.90	0.00
18	301291	明阳电气	349	10,829.47	0.00
19	688469	中芯集成	2,001	10,825.41	0.00

20	301315	威士顿	210	10,735.20	0.00
21	688543	国科军工	195	10,344.75	0.00
22	688620	安凯微	827	10,205.18	0.00
23	301310	鑫宏业	154	10,076.22	0.00
24	301303	真兰仪表	450	10,044.00	0.00
25	301325	曼恩斯特	91	9,823.45	0.00
26	301210	金杨股份	192	9,440.64	0.00
27	688576	西山科技	75	9,030.75	0.00
28	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
29	301408	华人健康	490	8,305.50	0.00
30	301141	中科磁业	190	8,111.10	0.00
31	301383	天键股份	226	8,072.72	0.00
32	688562	航天软件	360	8,031.60	0.00
33	688593	新相微	532	7,761.88	0.00
34	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
35	301397	溯联股份	188	7,557.60	0.00
36	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
37	301262	海看股份	291	7,420.50	0.00
38	301225	恒勃股份	222	7,383.72	0.00
39	688429	时创能源	289	7,378.17	0.00
40	688523	航天环宇	308	7,345.80	0.00
41	688484	南芯科技	193	7,085.03	0.00
42	301399	英特科技	137	7,065.09	0.00
43	301387	光大同创	154	6,985.44	0.00
44	301246	宏源药业	224	6,879.04	0.00
45	301376	致欧科技	304	6,843.04	0.00
46	688334	西高院	419	6,791.99	0.00
47	301170	锡南科技	194	6,776.42	0.00
48	688535	华海诚科	132	6,762.36	0.00
49	301382	蜂助手	203	6,666.52	0.00
50	301429	森泰股份	316	6,642.32	0.00
51	301360	荣旗科技	71	6,574.60	0.00
52	688458	美芯晟	71	6,443.96	0.00
53	688631	莱斯信息	215	6,422.05	0.00
54	301307	美利信	197	6,276.42	0.00
55	688352	颀中科技	520	6,276.40	0.00
56	688146	中船特气	159	6,062.67	0.00
57	688552	航天南湖	253	5,945.50	0.00
58	301232	飞沃科技	99	5,783.58	0.00
59	301355	南王科技	334	5,594.50	0.00
60	001287	中电港	265	5,570.30	0.00
61	301386	未来电器	230	5,471.70	0.00
62	688512	慧智微	282	5,403.12	0.00

63	688570	天玛智控	212	5,369.96	0.00
64	301332	德尔玛	387	5,313.51	0.00
65	688623	二元科技	60	5,207.40	0.00
66	301157	华塑科技	96	5,081.28	0.00
67	301357	北方长龙	105	5,080.95	0.00
68	688581	安杰思	43	5,075.29	0.00
69	301281	科源制药	200	5,020.00	0.00
70	301203	国泰环保	142	4,884.80	0.00
71	301323	新莱福	123	4,841.28	0.00
72	301439	泓淋电力	282	4,765.80	0.00
73	688433	华曙高科	149	4,693.50	0.00
74	601061	中信金属	586	4,441.88	0.00
75	301337	亚华电子	142	4,312.54	0.00
76	603135	中重科技	210	3,756.90	0.00
77	301345	涛涛车业	77	3,591.28	0.00
78	688479	友车科技	119	3,509.31	0.00
79	001380	华纬科技	112	3,447.36	0.00
80	601133	柏诚股份	199	2,439.74	0.00
81	601065	江盐集团	206	2,439.04	0.00
82	603137	恒尚节能	136	2,324.24	0.00
83	001328	登康口腔	84	2,141.16	0.00
84	001282	三联锻造	60	1,981.80	0.00
85	001324	长青科技	93	1,822.80	0.00
86	603172	万丰股份	112	1,806.56	0.00
87	603125	常青科技	66	1,618.98	0.00
88	001360	南矿集团	107	1,591.09	0.00
89	001367	海森药业	39	1,539.72	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	688981	中芯国际	99,203,482.55	9.23
2	603501	韦尔股份	73,939,914.50	6.88
3	603986	兆易创新	67,755,982.16	6.31
4	688012	中微公司	57,677,311.69	5.37
5	688008	澜起科技	49,196,112.51	4.58
6	002049	紫光国微	47,052,230.40	4.38
7	600745	闻泰科技	46,617,062.95	4.34
8	600703	三安光电	46,444,683.39	4.32
9	600584	长电科技	40,898,292.22	3.81
10	002371	北方华创	35,743,900.82	3.33
11	603290	斯达半导	33,377,081.56	3.11

12	600460	士兰微	30,665,307.43	2.85
13	688536	思瑞浦	29,631,329.39	2.76
14	688396	华润微	29,106,407.98	2.71
15	688126	沪硅产业	28,056,726.82	2.61
16	688099	晶晨股份	25,016,858.29	2.33
17	688256	寒武纪	23,530,598.05	2.19
18	605358	立昂微	23,212,138.56	2.16
19	688385	复旦微电	20,609,723.33	1.92
20	300661	圣邦股份	19,449,451.82	1.81

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	688981	中芯国际	100,102,622.67	9.32
2	603501	韦尔股份	79,512,671.86	7.40
3	603986	兆易创新	78,889,008.06	7.34
4	600703	三安光电	52,648,853.42	4.90
5	688012	中微公司	52,452,171.96	4.88
6	688008	澜起科技	50,659,715.41	4.72
7	600745	闻泰科技	50,581,028.52	4.71
8	600584	长电科技	43,616,156.98	4.06
9	603290	斯达半导	38,243,278.34	3.56
10	600460	士兰微	34,773,389.17	3.24
11	688536	思瑞浦	32,404,291.28	3.02
12	688396	华润微	31,955,467.81	2.97
13	688126	沪硅产业	28,404,208.91	2.64
14	605358	立昂微	27,425,308.59	2.55
15	688099	晶晨股份	25,164,923.52	2.34
16	688385	复旦微电	23,436,426.23	2.18
17	603160	汇顶科技	21,171,203.48	1.97
18	603893	瑞芯微	18,280,906.99	1.70
19	300661	圣邦股份	7,726,501.12	0.72
20	688728	格科微	6,128,418.39	0.57

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	973,025,657.17
卖出股票收入（成交）总额	837,563,715.08

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	1,756,449.06
2	应收清算款	4,527,196.78
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	6,359,262.08

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	688502	茂莱光学	140,907.51	0.02	新股锁定
2	301395	仁信新材	99,783.20	0.02	新股未上市
2	301395	仁信新材	11,098.88	0.00	新股锁定
3	301486	致尚科技	95,484.96	0.02	新股未上市
3	301486	致尚科技	10,609.44	0.00	新股锁定
4	301292	海科新源	89,395.28	0.02	新股未上市
4	301292	海科新源	9,935.03	0.00	新股锁定
5	688603	天承科技	67,100.00	0.01	新股未上市
5	688603	天承科技	7,480.00	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

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 (%)
10,680	51,739.41	64,808,086.00	11.73	487,768,774.00	88.27

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	福州庆源投资管理有限公司-庆源 18 号私募证券投资基金	9,569,200.00	1.73
2	招商证券股份有限公司	5,342,870.00	0.97
3	中国银河证券股份有限公司	5,337,065.00	0.97
4	中信建投证券股份有限公司	5,118,929.00	0.93
5	海南盛丰私募基金管理有限公司-盛丰优谷私募证券投资基金	4,930,000.00	0.89
6	福州庆源投资管理有限公司-庆源 8 号私募投资基金	4,781,500.00	0.87
7	卓晓慧	4,779,600.00	0.86
8	张燕华	4,753,200.00	0.86
9	上海量游资产管理有限公司-量游 1 号基金	4,537,700.00	0.82
10	蔡香美	3,716,900.00	0.67

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 12 月 22 日）基金份额总额	1,077,576,860.00
本报告期期初基金份额总额	1,077,576,860.00
本报告期基金总申购份额	579,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,104,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	552,576,860.00

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 2023 年 1 月 14 日发布公告，李剑峰先生自 2023 年 1 月 12 日起担任公司首席投资官，张波先生自 2023 年 1 月 12 日起担任公司首席营销官。

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、公募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安永华明会计师事务所（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

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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%)	
招商证券	4	1,803,583,55	100.00	1,238,843.18	100.00	-

		9.83			
--	--	------	--	--	--

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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信国证半导体芯片交易型开放	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 3 日

	式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告		
2	工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 3 日
3	关于工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 6 日
4	工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 6 日
5	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 14 日
6	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 14 日
7	关于工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 5 月 12 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信国证半导体芯片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

2023 年 8 月 30 日