

工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金

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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人浙商银行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 3 月 28 日（基金合同生效日）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	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	工银中证 1000 指数增强	
基金主代码	016942	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 28 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	135,647,376.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银中证 1000 指数增强 A	工银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016942	016943
报告期末下属分级基金的份额总额	86,033,033.30 份	49,614,343.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后) × 5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，长期来看，本基金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	浙商银行股份有限公司
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	95527
传真	010-66583158	0571-88268688

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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码	100033	310006
法定代表人	赵桂才	陆建强

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	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

§ 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	2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	工银中证 1000 指数增强 A	工银中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-97,687.48	-284,697.67
本期利润	-845,064.06	-756,381.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0069	-0.0093
本期加权平均净值利润率	-0.69%	-0.93%
本期基金份额净值增长率	0.04%	-0.07%
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	23,617.34	-40,217.66
期末可供分配基金份额利润	0.0003	-0.0008
期末基金资产净值	86,068,097.30	49,580,242.00

期末基金份额净值	1.0004	0.9993
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	0.04%	-0.07%

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。

5、本基金基金合同生效日为 2023 年 3 月 28 日。截至报告期末，本基金基金合同生效不满半年。

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

工银中证 1000 指数增强 A

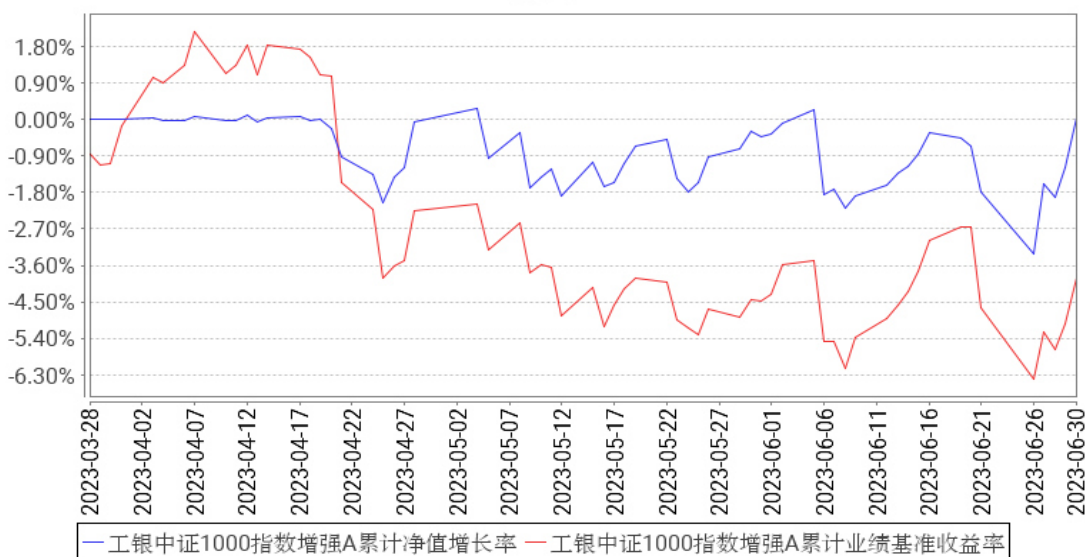
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.46%	0.87%	0.59%	0.99%	-0.13%	-0.12%
过去三个月	0.04%	0.66%	-3.77%	0.87%	3.81%	-0.21%
自基金合同生效起至今	0.04%	0.64%	-3.91%	0.86%	3.95%	-0.22%

工银中证 1000 指数增强 C

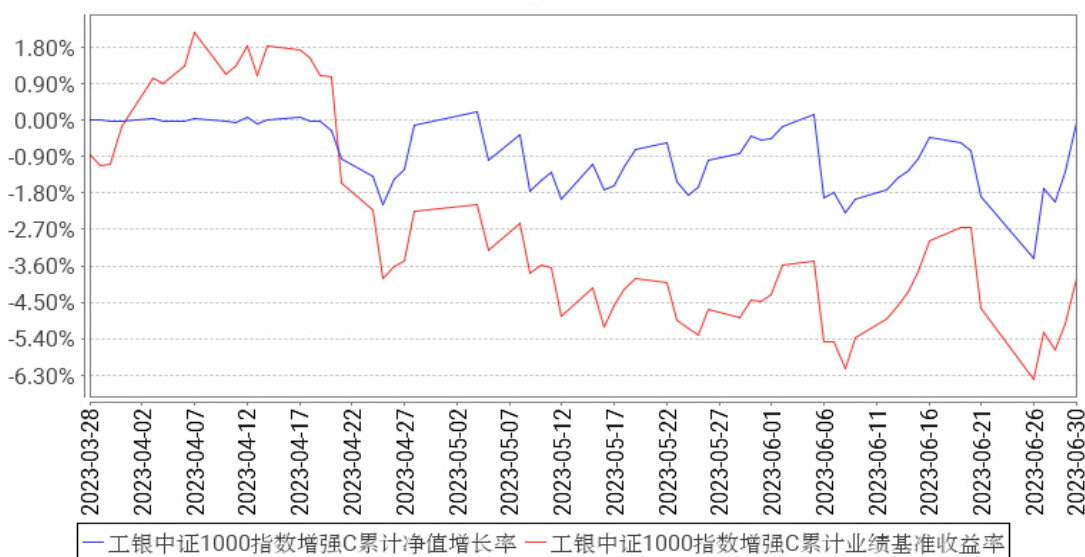
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.43%	0.88%	0.59%	0.99%	-0.16%	-0.11%
过去三个月	-0.06%	0.66%	-3.77%	0.87%	3.71%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-0.07%	0.64%	-3.91%	0.86%	3.84%	-0.22%

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1000指数增强A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



工银中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2023 年 03 月 28 日生效。截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

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。

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		
邓皓友	本基金的基金经理	2023 年 3 月 28 日	-	9 年	硕士研究生。曾在瀚华金控股份有限公司担任数据分析师；2014 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2019 年 10 月 29 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；2020 年 6 月 29 日至今，担任工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至 2023 年 3

					月 29 日,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; 2021 年 2 月 9 日至今,担任工银瑞信中证消费服务领先交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 3 月 24 日至今,担任工银瑞信大和日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理; 2021 年 6 月 18 日至今,担任工银瑞信中证 180ESG 交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 12 月 14 日至今,担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理; 2021 年 12 月 29 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发起式联接基金基金经理; 2023 年 3 月 28 日至今,担任工银瑞信中证 1000 指数增强型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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合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

本基金跟踪的标的指数为中证 1000 指数，业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。中证 1000 指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

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%。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，对于风格和行业进行较为严格的暴露控制，在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上，力争获取更高的超额收益。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与新股申购，力争增厚收益。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为 0.04%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为-3.91%，本基金 C 份额净值增长率为-0.07%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-3.91%。

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。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人——工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对工银瑞信基金管理有限公司编制和披露的工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、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 1000 指数增强型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	8,103,780.42
结算备付金		867,203.82
存出保证金		70,307.40
交易性金融资产	6.4.7.2	127,680,419.28
其中：股票投资		127,570,610.14
基金投资		-
债券投资		109,809.14
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		170,937.83
应收股利		-
应收申购款		132,279.74
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		137,024,928.49
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		675,673.44

应付管理人报酬		116,884.11
应付托管费		11,688.41
应付销售服务费		17,277.97
应付投资顾问费		-
应交税费		0.22
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	555,065.04
负债合计		1,376,589.19
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	135,647,376.83
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	962.47
净资产合计		135,648,339.30
负债和净资产总计		137,024,928.49

注：1、本基金基金合同生效日为 2023 年 3 月 28 日，本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止，下同。

2、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额为 135,647,376.83 份，其中工银中证 1000 指数增强 A 基金份额总额为 86,033,033.30 份，基金份额净值 1.0004 元；工银中证 1000 指数增强 C 基金份额总额为 49,614,343.53 份，基金份额净值 0.9993 元。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-898,161.01
1. 利息收入		179,196.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	79,252.79
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		99,943.45
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,496.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,297,095.90
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	8.94
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	1,327,583.80
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	-1,219,060.21
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	111,206.12
减：二、营业总支出		703,284.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	517,677.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,767.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	82,764.55
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.02
8. 其他费用	6.4.7.23	51,074.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,601,445.36
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,601,445.36
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,601,445.36

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
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）	300,955,732.80	-	-	300,955,732.80

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-165,308,355.97	-	962.47	-165,307,393.50
(一)、综合收益总额	-	-	-1,601,445.36	-1,601,445.36
(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)	-165,308,355.97	-	1,602,407.83	-163,705,948.14
其中：1. 基金申购款	8,467,619.71	-	-101,145.07	8,366,474.64
2. 基金赎回款	-173,775,975.68	-	1,703,552.90	-172,072,422.78
(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)	135,647,376.83	-	962.47	135,648,339.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵桂才

郝炜

关亚君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金(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[2022]2394 号《关于准予工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

300,861,425.89 元,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(2023)第 0161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 300,955,732.80 份基金份额,其中认购资金利息折合 94,306.91 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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 3 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日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。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 3 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损

益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

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

(4) 基金卖出股票按 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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	8,103,780.42
等于：本金	8,103,034.48
加：应计利息	745.94
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	8,103,780.42

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	128,789,670.35	-	127,570,610.14	-1,219,060.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	109,800.00	9.14	109,809.14
	银行间市场	-	-	-
	合计	109,800.00	9.14	109,809.14
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	128,899,470.35	9.14	127,680,419.28	-1,219,060.21
----	----------------	------	----------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	503,990.19
其中：交易所市场	503,990.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	17,024.95
预提信息披露费	34,049.90
合计	555,065.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

工银中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	169,219,210.39	169,219,210.39
本期申购	1,972,741.88	1,972,741.88
本期赎回（以“-”号填列）	-85,158,918.97	-85,158,918.97
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	86,033,033.30	86,033,033.30

工银中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	131,736,522.41	131,736,522.41
本期申购	6,494,877.83	6,494,877.83
本期赎回（以“-”号填列）	-88,617,056.71	-88,617,056.71
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	49,614,343.53	49,614,343.53

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 2023 年 3 月 28 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 300,955,732.80 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,306.91 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

工银中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-97,687.48	-747,376.58	-845,064.06
本期基金份额交易产生的变动数	121,304.82	758,823.24	880,128.06
其中：基金申购款	3,266.57	-24,057.49	-20,790.92
基金赎回款	118,038.25	782,880.73	900,918.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,617.34	11,446.66	35,064.00

工银中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-284,697.67	-471,683.63	-756,381.30
本期基金份额交易产生的变动数	244,480.01	477,799.76	722,279.77
其中：基金申购款	-1,095.30	-79,258.85	-80,354.15
基金赎回款	245,575.31	557,058.61	802,633.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,217.66	6,116.13	-34,101.53

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	74,461.31
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	4,619.38
其他	172.10
合计	79,252.79

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3月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,297,095.90
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,297,095.90

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3月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	285,660,788.36
减：卖出股票成本总额	286,113,185.47
减：交易费用	844,698.79
买卖股票差价收入	-1,297,095.90

6.4.7.14.3 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	8.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	8.94

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 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,327,583.80
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	1,327,583.80

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 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,219,060.21
股票投资	-1,219,060.21
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	-1,219,060.21

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	111,108.34
基金转换费收入	97.78
合计	111,206.12

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 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	17,024.95
信息披露费	34,049.90
证券出借违约金	-
合计	51,074.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金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、基金注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	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、基金销售机构

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
	2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	517,677.21
其中：支付销售机构的客户维护费	131,370.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,767.72

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 3 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银中证 1000 指数增 强 A	工银中证 1000 指数增 强 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	1,822.94	1,822.94
中国工商银行股份有限公司	-	2.12	2.12
合计	-	1,825.06	1,825.06

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年3月28日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
	浙商银行股份有限公司	8,103,780.42

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

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	1,948	51,972.64	51,972.64	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	828	47,742.48	47,742.48	-
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	2,305	46,076.95	46,076.95	-
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	594	32,670.00	32,670.00	-
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	811	29,925.90	29,925.90	-
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	1,077	27,808.14	27,808.14	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	619	6,870.90	10,547.76	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	295	11,174.60	8,699.55	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	122	8,208.16	7,982.46	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	374	3,463.24	6,952.66	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股锁定	135.80	120.41	57	7,740.60	6,863.37	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	161	4,305.14	6,549.48	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	174	8,031.84	6,215.28	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	414	4,628.52	6,040.26	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	118	3,810.22	6,032.16	-

		日									
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	217	5,789.56	5,789.56		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	242	5,290.12	5,771.70		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	183	6,977.79	5,678.49		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	169	6,026.54	5,620.94		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	103	4,498.01	5,464.15		-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	151	5,647.40	5,446.57		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	213	6,436.86	5,431.50		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	435	4,645.80	5,367.90		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	92	5,304.72	5,304.72		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	257	5,137.43	5,137.43		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	314	4,446.24	5,089.94		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	98	5,672.24	4,818.66		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	74	5,365.00	4,323.08		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	254	4,457.70	4,254.50		-
688570	天玛	2023年	6个月	新股锁	30.26	25.33	166	5,023.16	4,204.78		-

	智控	5月29日		定							
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	101	5,380.27	4,060.20		-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	119	5,051.55	3,923.43		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	151	2,899.20	3,855.03		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	44	5,538.72	3,818.76		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	97	3,788.82	3,817.92		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	168	4,142.88	3,781.68		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	66	3,630.00	3,630.00		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	103	3,502.00	3,597.79		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	91	3,357.90	3,357.90		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	111	2,806.08	3,315.57		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	120	3,098.40	3,098.40		-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023年6月13日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	1,098	109,800.00	109,809.14	-

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	109,809.14
未评级	-
合计	109,809.14

注：上述评级均取自第三方评级机构。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申

请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。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	8,103,780.42	-	-	-	8,103,780.42
结算备付金	867,203.82	-	-	-	867,203.82
存出保证金	70,307.40	-	-	-	70,307.40
交易性金融资产	-	-	109,809.14	127,570,610.14	127,680,419.28
应收清算款	-	-	-	170,937.83	170,937.83
应收申购款	-	-	-	132,279.74	132,279.74
资产总计	9,041,291.64	-	109,809.14	127,873,827.71	137,024,928.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	675,673.44	675,673.44
应付管理人报酬	-	-	-	116,884.11	116,884.11
应付托管费	-	-	-	11,688.41	11,688.41
应付销售服务费	-	-	-	17,277.97	17,277.97
应交税费	-	-	-	0.22	0.22
其他负债	-	-	-	555,065.04	555,065.04
负债总计	-	-	-	1,376,589.19	1,376,589.19
利率敏感度缺口	9,041,291.64	-	109,809.14	126,497,238.52	135,648,339.30

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
	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）
分析	利率减少 25 基准点	1,592.78
	利率增加 25 基准点	-1,566.04

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	127,570,610.14	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	109,809.14	0.08
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	127,680,419.28	94.13

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

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）
分析	业绩比较基准增加 5%	4,252,428.93
	业绩比较基准减少 5%	-4,252,428.93

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
第一层次	127,150,570.45
第二层次	372,323.26
第三层次	157,525.57
合计	127,680,419.28

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	127,570,610.14	93.10
	其中：股票	127,570,610.14	93.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	109,809.14	0.08
	其中：债券	109,809.14	0.08
	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	8,970,984.24	6.55
8	其他各项资产	373,524.97	0.27
9	合计	137,024,928.49	100.00

注：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	1,920,102.00	1.42
C	制造业	59,233,466.63	43.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,398,328.00	1.77
E	建筑业	2,966,746.00	2.19
F	批发和零售业	4,048,580.00	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	946,720.00	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,222,353.32	5.32
J	金融业	3,008,043.00	2.22
K	房地产业	2,163,997.00	1.60
L	租赁和商务服务业	2,001,287.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	1,196,460.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	2,270,064.00	1.67
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	3,095,586.00	2.28
S	综合	-	-
	合计	92,471,732.95	68.17

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。

7.2.2 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	1,100,916.00	0.81
C	制造业	20,571,537.84	15.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,105,503.00	0.81

F	批发和零售业	1,094,627.68	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,998,106.00	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,677,850.73	3.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,183,809.00	0.87
L	租赁和商务服务业	270,101.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	5,089.94	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,063,176.00	1.52
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	1,028,160.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	35,098,877.19	25.87

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	301050	雷电微力	19,400	1,259,642.00	0.93
2	600835	上海机电	73,000	1,254,140.00	0.92
3	600210	紫江企业	226,600	1,205,512.00	0.89
4	002262	恩华药业	38,700	1,193,121.00	0.88
5	300224	正海磁材	91,400	1,175,404.00	0.87
6	600729	重庆百货	37,300	1,172,712.00	0.86
7	300130	新国都	41,200	1,167,196.00	0.86
8	300054	鼎龙股份	47,100	1,164,783.00	0.86
9	002332	仙琚制药	87,700	1,162,025.00	0.86
10	002859	洁美科技	41,900	1,160,630.00	0.86
11	600587	新华医疗	32,800	1,158,824.00	0.85
12	301015	百洋医药	41,700	1,157,592.00	0.85

13	601126	四方股份	76,100	1,155,959.00	0.85
14	300762	上海瀚讯	97,600	1,148,752.00	0.85
15	600750	江中药业	52,100	1,142,553.00	0.84
16	605369	拱东医疗	20,300	1,137,612.00	0.84
17	600129	太极集团	19,000	1,130,310.00	0.83
18	000860	顺鑫农业	33,500	1,128,615.00	0.83
19	300027	华谊兄弟	404,200	1,127,718.00	0.83
20	002724	海洋王	129,800	1,126,664.00	0.83
21	600323	瀚蓝环境	59,500	1,126,335.00	0.83
22	002611	东方精工	194,100	1,114,134.00	0.82
23	300091	金通灵	373,400	1,112,732.00	0.82
24	600458	时代新材	92,600	1,110,274.00	0.82
25	600312	平高电气	89,300	1,106,427.00	0.82
26	000928	中钢国际	114,500	1,104,925.00	0.81
27	002891	中宠股份	45,700	1,103,198.00	0.81
28	300767	震安科技	43,500	1,103,160.00	0.81
29	600184	光电股份	83,700	1,098,981.00	0.81
30	301238	瑞泰新材	54,000	1,098,360.00	0.81
31	600273	嘉化能源	116,500	1,097,430.00	0.81
32	002990	盛视科技	29,800	1,096,640.00	0.81
33	002267	陕天然气	138,200	1,094,544.00	0.81
34	300860	锋尚文化	19,700	1,092,168.00	0.81
35	000426	兴业银锡	122,900	1,091,352.00	0.80
36	600531	豫光金铅	172,700	1,088,010.00	0.80
37	600986	浙文互联	169,800	1,086,720.00	0.80
38	000718	苏宁环球	397,800	1,085,994.00	0.80
39	600363	联创光电	29,200	1,083,320.00	0.80
40	300183	东软载波	65,600	1,083,056.00	0.80
41	000791	甘肃能源	206,600	1,080,518.00	0.80
42	300633	开立医疗	19,800	1,079,100.00	0.80
43	000528	柳工	135,200	1,068,080.00	0.79
44	300035	中科电气	88,500	1,063,770.00	0.78
45	002063	远光软件	122,500	1,063,300.00	0.78
46	601777	力帆科技	297,000	1,060,290.00	0.78
47	000498	山东路桥	163,300	1,048,386.00	0.77
48	002215	诺普信	139,200	1,045,392.00	0.77
49	000761	本钢板材	261,000	1,044,000.00	0.77
50	300772	运达股份	80,700	1,039,416.00	0.77
51	000061	农产品	171,200	1,025,488.00	0.76
52	002413	雷科防务	195,800	1,024,034.00	0.75
53	603989	艾华集团	46,900	987,714.00	0.73
54	002344	海宁皮城	206,300	975,799.00	0.72
55	300587	天铁股份	126,700	975,590.00	0.72

56	600908	无锡银行	180,100	965,336.00	0.71
57	002020	京新药业	75,000	961,500.00	0.71
58	300267	尔康制药	297,400	960,602.00	0.71
59	000088	盐田港	195,200	946,720.00	0.70
60	600649	城投控股	239,900	942,807.00	0.70
61	002516	旷达科技	191,300	925,892.00	0.68
62	002004	华邦健康	182,500	912,500.00	0.67
63	000652	泰达股份	219,800	905,576.00	0.67
64	603466	风语筑	63,000	875,700.00	0.65
65	000555	神州信息	70,400	865,920.00	0.64
66	002545	东方铁塔	118,200	834,492.00	0.62
67	601918	新集能源	195,000	828,750.00	0.61
68	601886	江河集团	91,500	813,435.00	0.60
69	601028	玉龙股份	75,600	812,700.00	0.60
70	300887	谱尼测试	20,500	811,390.00	0.60
71	600864	哈投股份	153,300	783,363.00	0.58
72	600783	鲁信创投	57,600	744,768.00	0.55
73	601011	宝泰隆	190,900	685,331.00	0.51
74	600572	康恩贝	99,200	679,520.00	0.50
75	002581	未名医药	34,700	662,423.00	0.49
76	600550	保变电气	125,900	634,536.00	0.47
77	000030	富奥股份	124,800	628,992.00	0.46
78	601200	上海环境	66,000	626,340.00	0.46
79	002573	清新环境	93,900	517,389.00	0.38
80	601099	太平洋	184,900	477,042.00	0.35
81	002747	埃斯顿	16,200	453,600.00	0.33
82	300377	赢时胜	53,800	435,780.00	0.32
83	688617	惠泰医疗	800	299,000.00	0.22
84	688037	芯源微	1,480	253,006.00	0.19
85	688050	爱博医疗	1,200	246,396.00	0.18
86	688017	绿的谐波	1,500	243,600.00	0.18
87	688598	金博股份	1,400	240,100.00	0.18
88	688556	高测股份	4,404	234,028.56	0.17
89	688139	海尔生物	4,300	221,321.00	0.16
90	688639	华恒生物	2,420	218,961.60	0.16
91	601929	吉视传媒	117,500	216,200.00	0.16
92	688019	安集科技	1,300	214,279.00	0.16
93	688023	安恒信息	1,200	209,652.00	0.15
94	688066	航天宏图	3,420	208,278.00	0.15
95	688608	恒玄科技	1,700	205,751.00	0.15
96	603043	广州酒家	7,200	203,472.00	0.15
97	688333	铂力特	1,880	198,791.20	0.15
98	688027	国盾量子	1,100	174,152.00	0.13

99	688083	中望软件	1,200	173,868.00	0.13
100	688425	铁建重工	34,588	166,368.28	0.12
101	688700	东威科技	1,668	166,349.64	0.12
102	688266	泽璟制药	3,400	158,270.00	0.12
103	688106	金宏气体	5,780	157,216.00	0.12
104	300856	科思股份	1,900	149,663.00	0.11
105	688686	奥普特	900	148,032.00	0.11
106	688016	心脉医疗	800	143,904.00	0.11
107	688518	联赢激光	4,950	137,907.00	0.10
108	688007	光峰科技	6,597	137,547.45	0.10
109	688711	宏微科技	2,350	137,099.00	0.10
110	000690	宝新能源	19,300	135,486.00	0.10
111	600007	中国国贸	7,300	135,196.00	0.10
112	688158	优刻得	7,069	133,462.72	0.10
113	688321	微芯生物	5,826	131,900.64	0.10
114	688707	振华新材	4,281	131,811.99	0.10
115	688018	乐鑫科技	1,000	129,820.00	0.10
116	688578	艾力斯	4,784	128,928.80	0.10
117	688388	嘉元科技	4,777	128,596.84	0.09
118	688408	中信博	1,524	128,518.92	0.09
119	688696	极米科技	900	125,451.00	0.09
120	688559	海目星	2,658	124,952.58	0.09
121	300166	东方国信	10,800	121,392.00	0.09
122	688339	亿华通	1,400	119,000.00	0.09
123	688202	美迪西	1,340	114,235.00	0.08
124	688131	皓元医药	2,000	113,960.00	0.08
125	688033	天宜上佳	5,941	113,591.92	0.08
126	688568	中科星图	1,400	112,812.00	0.08
127	688278	特宝生物	2,500	109,775.00	0.08
128	688680	海优新材	900	109,638.00	0.08
129	688298	东方生物	2,840	107,124.80	0.08
130	688198	佰仁医疗	1,000	106,110.00	0.08
131	688789	宏华数科	1,160	102,462.80	0.08
132	688575	亚辉龙	5,546	102,323.70	0.08
133	688508	芯朋微	1,700	98,583.00	0.07
134	688800	瑞可达	1,580	98,197.00	0.07
135	688277	天智航	5,261	97,012.84	0.07
136	688166	博瑞医药	4,400	96,756.00	0.07
137	688776	国光电气	1,120	92,825.60	0.07
138	002746	仙坛股份	11,700	92,196.00	0.07
139	688798	艾为电子	1,540	91,091.00	0.07
140	688389	普门科技	3,856	90,577.44	0.07
141	688100	威胜信息	3,000	89,430.00	0.07

142	600483	福能股份	7,600	87,780.00	0.06
143	688356	键凯科技	800	85,240.00	0.06
144	688133	泰坦科技	1,000	85,190.00	0.06
145	688586	江航装备	6,027	83,835.57	0.06
146	688383	新益昌	600	83,532.00	0.06
147	002017	东信和平	6,200	81,282.00	0.06
148	688318	财富趋势	780	77,976.60	0.06
149	688366	昊海生科	900	75,798.00	0.06
150	688676	金盘科技	2,500	75,725.00	0.06
151	688085	三友医疗	2,860	75,103.60	0.06
152	688733	壹石通	2,400	74,304.00	0.05
153	688148	芳源股份	5,911	72,114.20	0.05
154	688315	诺禾致源	2,700	71,685.00	0.05
155	688526	科前生物	2,900	68,991.00	0.05
156	002446	盛路通信	7,300	68,985.00	0.05
157	688499	利元亨	1,060	67,331.20	0.05
158	688268	华特气体	800	64,584.00	0.05
159	688368	晶丰明源	500	63,605.00	0.05
160	688660	电气风电	11,118	61,927.26	0.05
161	688127	蓝特光学	3,500	61,705.00	0.05
162	688233	神工股份	1,900	60,002.00	0.04
163	002171	楚江新材	8,300	59,096.00	0.04
164	688330	宏力达	1,540	54,023.20	0.04
165	688399	硕世生物	900	49,680.00	0.04
166	688001	华兴源创	1,400	49,588.00	0.04
167	688161	威高骨科	1,100	47,641.00	0.04
168	688699	明微电子	900	45,288.00	0.03
169	688128	中国电研	1,700	43,350.00	0.03
170	600120	浙江东方	9,800	37,534.00	0.03
171	688739	成大生物	1,000	32,960.00	0.02
172	601212	白银有色	11,700	31,824.00	0.02
173	000848	承德露露	1,900	16,815.00	0.01

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	300287	飞利信	276,500	1,230,425.00	0.91
2	002595	豪迈科技	33,100	1,162,803.00	0.86
3	301106	骏成科技	32,400	1,154,088.00	0.85
4	300127	银河磁体	62,700	1,136,751.00	0.84
5	605155	西大门	77,500	1,124,525.00	0.83
6	600768	宁波富邦	102,600	1,113,210.00	0.82
7	300815	玉禾田	74,700	1,111,536.00	0.82
8	002830	名雕股份	86,300	1,105,503.00	0.81

9	600028	中国石化	173,100	1,100,916.00	0.81
10	603390	通达电气	130,000	1,092,000.00	0.81
11	300184	力源信息	217,300	1,090,846.00	0.80
12	300219	鸿利智汇	147,700	1,085,595.00	0.80
13	603577	汇金通	110,300	1,083,146.00	0.80
14	002793	罗欣药业	198,700	1,070,993.00	0.79
15	603613	国联股份	28,950	1,069,123.50	0.79
16	000903	云内动力	451,600	1,065,776.00	0.79
17	000838	财信发展	270,600	1,060,752.00	0.78
18	300791	仙乐健康	36,300	1,054,152.00	0.78
19	300074	华平股份	243,100	1,047,761.00	0.77
20	002899	英派斯	69,900	1,046,403.00	0.77
21	000607	华媒控股	204,000	1,028,160.00	0.76
22	600548	深高速	114,000	1,023,720.00	0.75
23	000507	珠海港	176,200	974,386.00	0.72
24	603655	朗博科技	38,700	969,822.00	0.71
25	601827	三峰环境	128,600	951,640.00	0.70
26	300439	美康生物	80,100	905,931.00	0.67
27	300043	星辉娱乐	237,100	884,383.00	0.65
28	002293	罗莱生活	63,800	733,700.00	0.54
29	002687	乔治白	119,800	575,040.00	0.42
30	300832	新产业	9,300	548,700.00	0.40
31	600525	长园集团	81,500	479,220.00	0.35
32	002998	优彩资源	66,400	471,440.00	0.35
33	603602	纵横通信	35,100	431,379.00	0.32
34	300128	锦富技术	103,300	430,761.00	0.32
35	688516	奥特维	1,500	282,600.00	0.21
36	600826	兰生股份	26,300	270,101.00	0.20
37	003036	泰坦股份	18,600	250,728.00	0.18
38	688200	华峰测控	1,476	225,828.00	0.17
39	603826	坤彩科技	4,400	220,000.00	0.16
40	688276	百克生物	2,900	181,540.00	0.13
41	688778	厦钨新能	3,500	173,250.00	0.13
42	688520	神州细胞	2,900	164,546.00	0.12
43	002996	顺博合金	11,900	143,990.00	0.11
44	002133	广宇集团	36,300	123,057.00	0.09
45	600590	泰豪科技	16,900	120,497.00	0.09
46	301395	仁信新材	2,165	57,762.20	0.04
47	301486	致尚科技	920	53,047.20	0.04
48	301292	海科新源	2,562	51,214.38	0.04
49	600261	阳光照明	12,300	44,895.00	0.03
50	688788	科思科技	900	37,305.00	0.03
51	688603	天承科技	660	36,300.00	0.03

52	301261	恒工精密	902	33,283.80	0.02
53	301202	朗威股份	1,197	30,906.54	0.02
54	603102	百合股份	600	25,914.00	0.02
55	688472	阿特斯	619	10,547.76	0.01
56	688443	智翔金泰	295	8,699.55	0.01
57	301310	鑫宏业	122	7,982.46	0.01
58	688629	华丰科技	374	6,952.66	0.01
59	688576	西山科技	57	6,863.37	0.01
60	688582	芯动联科	161	6,549.48	0.00
61	301383	天键股份	174	6,215.28	0.00
62	688593	新相微	414	6,040.26	0.00
63	301315	威士顿	118	6,032.16	0.00
64	688523	航天环宇	242	5,771.70	0.00
65	301291	明阳电气	183	5,678.49	0.00
66	301225	恒勃股份	169	5,620.94	0.00
67	688543	国科军工	103	5,464.15	0.00
68	301295	美硕科技	151	5,446.57	0.00
69	301262	海看股份	213	5,431.50	0.00
70	688620	安凯微	435	5,367.90	0.00
71	688334	西高院	314	5,089.94	0.00
72	301210	金杨股份	98	4,818.66	0.00
73	301232	飞沃科技	74	4,323.08	0.00
74	301355	南王科技	254	4,254.50	0.00
75	688570	天玛智控	166	4,204.78	0.00
76	301397	溯联股份	101	4,060.20	0.00
77	300804	广康生化	119	3,923.43	0.00
78	688429	时创能源	151	3,855.03	0.00
79	688623	二元科技	44	3,818.76	0.00
80	301323	新莱福	97	3,817.92	0.00
81	301376	致欧科技	168	3,781.68	0.00
82	301170	锡南科技	103	3,597.79	0.00
83	688631	莱斯信息	111	3,315.57	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600129	太极集团	3,552,120.00	2.62
2	300860	锋尚文化	3,351,896.08	2.47
3	300183	东软载波	3,062,372.00	2.26
4	002581	未名医药	2,735,881.00	2.02
5	000791	甘肃能源	2,474,733.00	1.82
6	603893	瑞芯微	2,471,182.00	1.82

7	600750	江中药业	2,464,070.00	1.82
8	600771	广誉远	2,458,656.00	1.81
9	002990	盛视科技	2,456,008.00	1.81
10	600587	新华医疗	2,438,268.00	1.80
11	600559	老白干酒	2,407,981.00	1.78
12	002487	大金重工	2,403,847.00	1.77
13	600007	中国国贸	2,375,901.00	1.75
14	300587	天铁股份	2,368,951.62	1.75
15	603338	浙江鼎力	2,363,668.00	1.74
16	002461	珠江啤酒	2,313,150.00	1.71
17	600835	上海机电	2,309,883.00	1.70
18	002929	润建股份	2,307,115.00	1.70
19	600729	重庆百货	2,283,985.00	1.68
20	002034	旺能环境	2,281,634.00	1.68

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300031	宝通科技	3,418,299.22	2.52
2	600129	太极集团	2,884,162.00	2.13
3	300747	锐科激光	2,496,117.00	1.84
4	002979	雷赛智能	2,431,359.65	1.79
5	300860	锋尚文化	2,403,742.52	1.77
6	002487	大金重工	2,389,362.00	1.76
7	600771	广誉远	2,325,373.00	1.71
8	600007	中国国贸	2,305,724.00	1.70
9	603666	亿嘉和	2,300,565.00	1.70
10	603893	瑞芯微	2,298,676.00	1.69
11	002581	未名医药	2,278,538.00	1.68
12	600055	万东医疗	2,262,775.00	1.67
13	002126	银轮股份	2,241,239.00	1.65
14	002929	润建股份	2,224,966.00	1.64
15	603129	春风动力	2,222,402.00	1.64
16	002034	旺能环境	2,217,886.00	1.64
17	300394	天孚通信	2,207,203.00	1.63
18	002461	珠江啤酒	2,186,689.00	1.61
19	300393	中来股份	2,165,113.90	1.60
20	300679	电连技术	2,141,702.88	1.58

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	414,902,855.82
卖出股票收入（成交）总额	285,660,788.36

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	109,809.14	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,809.14	0.08

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。

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127086	恒邦转债	1,098	109,809.14	0.08

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	70,307.40
2	应收清算款	170,937.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	132,279.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,524.97

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

份额单位：份

份额级别	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 (%)
工银中证 1000 指数增强 A	1,476	58,287.96	380,854.99	0.44	85,652,178.31	99.56
工银中证 1000 指数增强 C	794	62,486.58	100,016.00	0.20	49,514,327.53	99.80
合计	2,270	59,756.55	480,870.99	0.35	135,166,505.84	99.65

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	工银中证 1000 指数增强 A	0
	工银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银中证 1000 指数增强 A	0
	工银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银中证 1000 指数增强 A	工银中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 28 日) 基金份额总额	169,219,210.39	131,736,522.41
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,972,741.88	6,494,877.83
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	85,158,918.97	88,617,056.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	86,033,033.30	49,614,343.53
-------------	---------------	---------------

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

基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告，自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	2	698,747,450.97	100.00	503,990.19	100.00	-

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。

表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)				的比例 (%)
方正证券	-	-	200,100,000.00	100.00	-	-

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	工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 3 月 29 日
2	工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 21 日
3	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金近期交易日安排的通知	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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中证 1000 指数增强型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 1000 指数增强型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