

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	11
§ 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 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	47
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	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银沪深 300ETF
场内简称	工银 300、工银沪深 300ETF
基金主代码	510350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 20 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	856,914,701.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 8 月 16 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%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	工银瑞信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95599
传真	010-66583158	010-68121816
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、	北京市东城区建国门内大街 69 号

	甲 5 号 9 层甲 5 号 901	
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王海璐	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人或基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	88,876,548.82
本期利润	80,928,922.58
加权平均基金份额本期利润	0.0883
本期加权平均净值利润率	2.25%
本期基金份额净值增长率	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	83,606,735.89
期末可供分配基金份额利润	0.0976
期末基金资产净值	3,571,675,677.02
期末基金份额净值	4.1681
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	9.32%

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

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

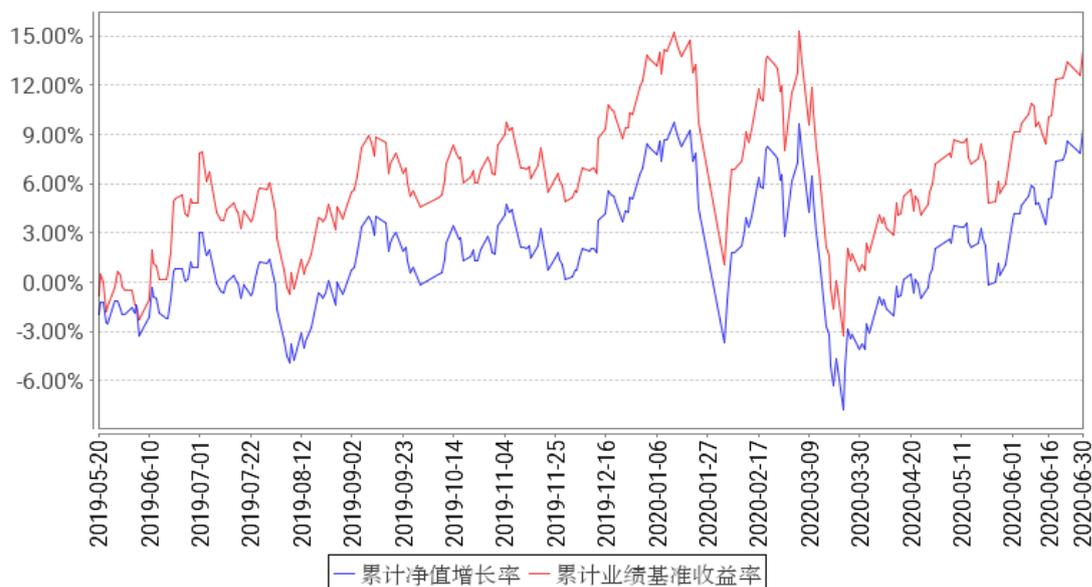
3.2 基金净值表现

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	8.13%	0.89%	7.68%	0.90%	0.45%	-0.01%
过去三个月	13.62%	0.89%	12.96%	0.90%	0.66%	-0.01%
过去六个月	2.20%	1.51%	1.64%	1.52%	0.56%	-0.01%
过去一年	8.35%	1.20%	8.85%	1.22%	-0.50%	-0.02%
自基金合同生效起至今	9.32%	1.17%	14.12%	1.21%	-4.80%	-0.04%

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

工银沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 5 月 20 日生效。

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：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%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

的投资管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	本基金的基金经理	2019年5月20日	-	10年	中国人民大学金融工程博士；2010年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心产品及营销支持部研究负责人兼指数基金基金经理。2014年10月17日至今，担任工银深证100指数分级基金（自2018年4月17日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF））基金经理；2014年10月17日至今，担任工银沪深300指数基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银中证500指数分级基金（自2020年2月18日起变更为工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2015年5月21日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理；2015年7月23日至今，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理；2017年9月15日至2018年5月4日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理；2018年6月15日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金（LOF）基金经理；2019年5月20日至今，担任工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年8月21日至今，担任工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019年10月17日至今，担任工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年11月1日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019年12月25日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年6月1日至今，担任工银瑞信中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有2次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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 2.20%，业绩比较基准收益率为 1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

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

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

（2）专业胜任能力及相关工作经历

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

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	53,358,033.09	33,144,291.82
结算备付金		1,240,609.82	356,253.47
存出保证金		382,370.27	1,067,496.55
交易性金融资产	6.4.7.2	3,521,013,731.53	3,912,346,341.91
其中：股票投资		3,521,013,731.53	3,912,346,341.91

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,380,478.84	817,734.50
应收利息	6.4.7.5	22,122.04	19,967.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,579,397,345.59	3,947,752,085.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		-	548,538.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,304,827.55	1,493,689.61
应付托管费		289,961.69	331,931.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	607,369.10	401,347.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	5,519,510.23	2,408,066.85
负债合计		7,721,668.57	5,183,573.11
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,267,344,839.00	3,686,003,152.39
未分配利润	6.4.7.10	304,330,838.02	256,565,360.38
所有者权益合计		3,571,675,677.02	3,942,568,512.77
负债和所有者权益总计		3,579,397,345.59	3,947,752,085.88

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

2、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 4.1681 元，基金份额总额为 856,914,701.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 5 月 20 日（基金合 同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		93,649,333.53	72,919,192.82
1. 利息收入		353,407.00	1,135,468.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	353,407.00	1,135,468.31
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		101,461,639.35	-17,081,670.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	65,939,723.09	-57,237,565.99
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	35,521,916.26	40,155,895.50
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,947,626.24	88,657,154.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	-218,086.58	208,240.20
减：二、费用		12,720,410.95	12,079,856.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,068,877.66	3,425,150.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,793,083.91	761,144.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,148,400.77	7,641,075.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	-

7. 其他费用	6.4.7.20	710,048.61	252,485.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		80,928,922.58	60,839,336.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		80,928,922.58	60,839,336.37

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,686,003,152.39	256,565,360.38	3,942,568,512.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	80,928,922.58	80,928,922.58
三、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）	-418,658,313.39	-33,163,444.94	-451,821,758.33
其中：1. 基金申购款	1,338,333,952.06	27,330,771.53	1,365,664,723.59
2. 基金赎回款	-1,756,992,265.45	-60,494,216.47	-1,817,486,481.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,267,344,839.00	304,330,838.02	3,571,675,677.02
项目	上年度可比期间 2019 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	6,863,688,383.00	-	6,863,688,383.00

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	60,839,336.37	60,839,336.37
三、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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,863,688,383.00	60,839,336.37	6,924,527,719.37

注: 本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

王海璐

赵紫英

关亚君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2139 号《关于准予工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,863,688,383.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0299 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基

金份额总额为 6,863,688,383.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人工银瑞信基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“工银沪深 300 ETF 联接基金”)。工银沪深 300 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	53,358,033.09
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	53,358,033.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,233,425,332.54	3,521,013,731.53	287,588,398.99

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	3,233,425,332.54	3,521,013,731.53	287,588,398.99

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	21,391.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	558.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	172.00
合计	22,122.04

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	607,369.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	607,369.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	47,239.92
指数使用费	259,485.77
预提信息披露费	59,672.34
IOPV 服务费	49,726.04
应退替代款	5,076,276.96
可退替代款	27,109.20
合计	5,519,510.23

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

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

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	966,714,701.00	3,686,003,152.39
本期申购	351,000,000.00	1,338,333,952.06
本期赎回（以“-”号填列）	-460,800,000.00	-1,756,992,265.45
- 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	856,914,701.00	3,267,344,839.00
-----	----------------	------------------

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

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	892,158.18	255,673,202.20	256,565,360.38
本期利润	88,876,548.82	-7,947,626.24	80,928,922.58
本期基金份额交易产生的变动数	-6,161,971.11	-27,001,473.83	-33,163,444.94
其中：基金申购款	15,309,907.85	12,020,863.68	27,330,771.53
基金赎回款	-21,471,878.96	-39,022,337.51	-60,494,216.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,606,735.89	220,724,102.13	304,330,838.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	335,814.83
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	13,850.50
其他	3,741.67
合计	353,407.00

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	65,852,160.19
股票投资收益——赎回差价收入	87,562.90
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	65,939,723.09

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	918,635,994.29
减：卖出股票成本总额	852,783,834.10
买卖股票差价收入	65,852,160.19

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,817,486,481.92
减：现金支付赎回款总额	637,831,953.92
减：赎回股票成本总额	1,179,566,965.10
赎回差价收入	87,562.90

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	35,521,916.26
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	35,521,916.26

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,947,626.24
股票投资	-7,947,626.24
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	-7,947,626.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-218,086.58
合计	-218,086.58

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,148,400.77
银行间市场交易费用	-
合计	2,148,400.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	47,239.92
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
IOPV 服务费	49,726.04
银行费用	15,485.16
指数使用费	537,925.15
合计	710,048.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,068,877.66	3,425,150.67
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

$$H = E \times 0.45\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,793,083.91	761,144.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

$$\text{托管费的计算方法如下：} \quad H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
工银瑞信沪深 300交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金	23,118,200.00	2.70	64,618,200.00	6.68

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30 日	上年度可比期间 2019年5月20日（基金合同生效日）至2019 年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	53,358,033.09	335,814.83	750,273,772.22	1,123,632.82

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

于本报告期末，本基金持有 8,342,200.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 45,278,914.90 元，估值总额为人民币 41,544,156.00 元，占基金资产净值的比例为 1.16%。

于本报告期末，本基金持有 6,804,600.00 股农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 24,161,482.31 元，估值总额为人民币 22,999,548.00 元，占基金资产净值的比例为 0.64%。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

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、内控稽核部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施。在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策，公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	53,358,033.09	-	-	-	-	-	53,358,033.09
结算备付金	1,240,609.82	-	-	-	-	-	1,240,609.82
存出保证金	382,370.27	-	-	-	-	-	382,370.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,521,013,731.53	3,521,013,731.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,380,478.84	3,380,478.84
应收利息	-	-	-	-	-	22,122.04	22,122.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,981,013.18	-	-	-	-	3,524,416,332.41	3,579,397,345.59
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,304,827.55	1,304,827.55
应付托管费	-	-	-	-	-	289,961.6	289,961.69

						9	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	607,369.10	607,369.10
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	5,519,510.23	5,519,510.23
负债总计	-	-	-	-	-	7,721,668.57	7,721,668.57
利率敏感度缺口	54,981,013.18	-	-	-	-	3,516,694,663.84	3,571,675,677.02
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	33,144,291.82	-	-	-	-	-	33,144,291.82
结算备付金	356,253.47	-	-	-	-	-	356,253.47
存出保证金	1,067,496.55	-	-	-	-	-	1,067,496.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,912,346,341.91	3,912,346,341.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	817,734.50	817,734.50
应收利息	-	-	-	-	-	19,967.63	19,967.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	34,568,041.84	-	-	-	-	3,913,184,044.04	3,947,752,085.88
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	548,538.00	548,538.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,493,689.61	1,493,689.61
应付托管费	-	-	-	-	-	331,931.05	331,931.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	401,347.60	401,347.60
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,408,066.85	2,408,066.85
负债总计	-	-	-	-	-	5,183,573.11	5,183,573.11
利率敏感度缺口	34,568,041.84	-	-	-	-	3,908,000,470.93	3,942,568,512.77

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

整体波动的影响。

本基金采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,521,013,731.53	98.58	3,912,346,341.91	99.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,521,013,731.53	98.58	3,912,346,341.91	99.23

注：1、本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的

	相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	177,051,645.74	174,741,996.53
	业绩比较基准减少 5%	-177,051,645.74	-174,741,996.53

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,521,013,731.53	98.37
	其中：股票	3,521,013,731.53	98.37
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	54,598,642.91	1.53
8	其他各项资产	3,784,971.15	0.11
9	合计	3,579,397,345.59	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	52,417,094.80	1.47
B	采矿业	84,997,436.81	2.38
C	制造业	1,688,228,114.30	47.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,613,545.68	2.01
E	建筑业	69,601,967.52	1.95
F	批发和零售业	36,348,325.27	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	98,781,592.06	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,977,133.97	4.03
J	金融业	998,644,727.29	27.96
K	房地产业	131,913,960.04	3.69
L	租赁和商务服务业	50,369,676.72	1.41
M	科学研究和技术服务业	23,682,745.80	0.66
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	4,478,350.50	0.13
Q	卫生和社会工作	43,081,924.55	1.21
R	文化、体育和娱乐业	22,876,478.22	0.64
S	综合	-	-
	合计	3,521,013,073.53	98.58

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,577,588	184,039,783.20	5.15
2	600519	贵州茅台	119,960	175,487,084.80	4.91
3	600036	招商银行	2,453,988	82,748,475.36	2.32
4	600276	恒瑞医药	884,372	81,627,535.60	2.29
5	000858	五粮液	461,996	79,056,755.52	2.21
6	000333	美的集团	1,167,783	69,821,745.57	1.95
7	000651	格力电器	1,146,197	64,840,364.29	1.82
8	002475	立讯精密	999,366	51,317,444.10	1.44
9	600030	中信证券	2,025,502	48,834,853.22	1.37
10	601166	兴业银行	2,962,250	46,744,305.00	1.31
11	600887	伊利股份	1,443,618	44,939,828.34	1.26
12	000002	万科A	1,623,301	42,433,088.14	1.19
13	601398	工商银行	8,342,200	41,544,156.00	1.16
14	600900	长江电力	2,092,313	39,628,408.22	1.11
15	601888	中国中免	231,924	35,723,253.72	1.00
16	601328	交通银行	6,527,500	33,486,075.00	0.94
17	300059	东方财富	1,536,872	31,044,814.40	0.87
18	600585	海螺水泥	570,882	30,205,366.62	0.85
19	000725	京东方A	6,454,800	30,143,916.00	0.84
20	000001	平安银行	2,313,000	29,606,400.00	0.83
21	600000	浦发银行	2,790,867	29,527,372.86	0.83
22	002714	牧原股份	356,791	29,256,862.00	0.82
23	000661	长春高新	66,854	29,101,546.20	0.81
24	603288	海天味业	231,973	28,857,441.20	0.81
25	600016	民生银行	5,056,200	28,668,654.00	0.80
26	002415	海康威视	891,174	27,047,130.90	0.76
27	600031	三一重工	1,404,172	26,342,266.72	0.74
28	601688	华泰证券	1,388,098	26,096,242.40	0.73
29	000063	中兴通讯	642,549	25,785,491.37	0.72
30	601012	隆基股份	625,574	25,479,629.02	0.71
31	600048	保利地产	1,700,800	25,137,824.00	0.70
32	600837	海通证券	1,924,591	24,211,354.78	0.68
33	601668	中国建筑	4,976,200	23,736,474.00	0.66
34	603259	药明康德	245,163	23,682,745.80	0.66
35	300498	温氏股份	1,062,396	23,160,232.80	0.65
36	601288	农业银行	6,804,600	22,999,548.00	0.64
37	600570	恒生电子	198,387	21,366,279.90	0.60

38	300015	爱尔眼科	480,559	20,880,288.55	0.58
39	601601	中国太保	747,244	20,362,399.00	0.57
40	000100	TCL 科技	3,219,300	19,959,660.00	0.56
41	601229	上海银行	2,366,033	19,638,073.90	0.55
42	300142	沃森生物	366,150	19,171,614.00	0.54
43	002142	宁波银行	714,767	18,776,929.09	0.53
44	600309	万华化学	372,721	18,632,322.79	0.52
45	601211	国泰君安	1,072,815	18,516,786.90	0.52
46	603986	兆易创新	77,980	18,396,261.80	0.52
47	601988	中国银行	4,992,600	17,374,248.00	0.49
48	002352	顺丰控股	316,793	17,328,577.10	0.49
49	601169	北京银行	3,521,374	17,254,732.60	0.48
50	600588	用友网络	386,761	17,056,160.10	0.48
51	600009	上海机场	230,126	16,585,180.82	0.46
52	601766	中国中车	2,889,856	16,096,497.92	0.45
53	600690	海尔智家	901,297	15,952,956.90	0.45
54	002241	歌尔股份	540,600	15,872,016.00	0.44
55	000568	泸州老窖	174,153	15,868,821.36	0.44
56	000338	潍柴动力	1,142,393	15,673,631.96	0.44
57	002594	比亚迪	216,881	15,572,055.80	0.44
58	300122	智飞生物	151,900	15,212,785.00	0.43
59	002410	广联达	215,968	15,052,969.60	0.42
60	002304	洋河股份	142,495	14,981,924.30	0.42
61	000876	新希望	502,705	14,980,609.00	0.42
62	600999	招商证券	680,400	14,934,780.00	0.42
63	600703	三安光电	582,960	14,574,000.00	0.41
64	601899	紫金矿业	3,264,977	14,365,898.80	0.40
65	600104	上汽集团	832,745	14,148,337.55	0.40
66	002555	三七互娱	302,255	14,145,534.00	0.40
67	002230	科大讯飞	365,929	13,696,722.47	0.38
68	002027	分众传媒	2,448,900	13,640,373.00	0.38
69	601818	光大银行	3,789,100	13,564,978.00	0.38
70	600745	闻泰科技	107,200	13,501,840.00	0.38
71	002007	华兰生物	259,820	13,019,580.20	0.36
72	300601	康泰生物	79,800	12,940,368.00	0.36
73	300347	泰格医药	125,700	12,806,316.00	0.36
74	001979	招商蛇口	754,551	12,404,818.44	0.35
75	600028	中国石化	3,166,800	12,382,188.00	0.35
76	600919	江苏银行	2,174,870	12,331,512.90	0.35
77	600436	片仔癀	71,200	12,121,800.00	0.34
78	000538	云南白药	122,200	11,463,582.00	0.32
79	600547	山东黄金	310,195	11,359,340.90	0.32

80	601088	中国神华	783,500	11,251,060.00	0.32
81	600406	国电南瑞	547,689	11,090,702.25	0.31
82	300413	芒果超媒	169,430	11,046,836.00	0.31
83	000895	双汇发展	238,200	10,978,638.00	0.31
84	000166	申万宏源	2,149,000	10,852,450.00	0.30
85	300003	乐普医疗	297,100	10,850,092.00	0.30
86	601628	中国人寿	396,109	10,778,125.89	0.30
87	600050	中国联通	2,210,600	10,699,304.00	0.30
88	600438	通威股份	612,936	10,652,827.68	0.30
89	002271	东方雨虹	261,307	10,616,903.41	0.30
90	300014	亿纬锂能	220,151	10,534,225.35	0.29
91	002129	中环股份	466,200	10,470,852.00	0.29
92	601009	南京银行	1,426,900	10,459,177.00	0.29
93	000938	紫光股份	242,640	10,428,667.20	0.29
94	601939	建设银行	1,595,700	10,068,867.00	0.28
95	000776	广发证券	706,700	9,978,604.00	0.28
96	601006	大秦铁路	1,413,400	9,950,336.00	0.28
97	002371	北方华创	57,931	9,900,987.21	0.28
98	300136	信维通信	184,600	9,787,492.00	0.27
99	002460	赣锋锂业	182,000	9,749,740.00	0.27
100	600196	复星医药	287,192	9,721,449.20	0.27
101	601390	中国中铁	1,936,100	9,719,222.00	0.27
102	601857	中国石油	2,318,269	9,713,547.11	0.27
103	600019	宝钢股份	2,118,261	9,659,270.16	0.27
104	603019	中科曙光	247,480	9,503,232.00	0.27
105	000977	浪潮信息	240,400	9,418,872.00	0.26
106	002044	美年健康	652,000	9,395,320.00	0.26
107	002050	三花智控	427,749	9,367,703.10	0.26
108	300124	汇川技术	246,088	9,348,883.12	0.26
109	603160	汇顶科技	41,873	9,333,491.70	0.26
110	601186	中国铁建	1,093,900	9,166,882.00	0.26
111	002602	世纪华通	593,465	9,085,949.15	0.25
112	002311	海大集团	188,500	8,970,715.00	0.25
113	600015	华夏银行	1,464,031	8,959,869.72	0.25
114	002001	新和成	307,799	8,956,950.90	0.25
115	600809	山西汾酒	61,375	8,899,375.00	0.25
116	002624	完美世界	153,600	8,853,504.00	0.25
117	300433	蓝思科技	314,499	8,818,551.96	0.25
118	601336	新华保险	198,540	8,791,351.20	0.25
119	601989	中国重工	2,152,400	8,609,600.00	0.24
120	601933	永辉超市	908,982	8,526,251.16	0.24
121	002456	欧菲光	448,300	8,244,237.00	0.23

122	002236	大华股份	428,600	8,233,406.00	0.23
123	600958	东方证券	850,500	8,071,245.00	0.23
124	603501	韦尔股份	39,700	8,017,415.00	0.22
125	000157	中联重科	1,236,723	7,952,128.89	0.22
126	600352	浙江龙盛	619,000	7,917,010.00	0.22
127	600183	生益科技	270,100	7,905,827.00	0.22
128	600741	华域汽车	375,040	7,797,081.60	0.22
129	002024	苏宁易购	886,700	7,776,359.00	0.22
130	601377	兴业证券	1,112,312	7,619,337.20	0.21
131	601788	光大证券	464,442	7,458,938.52	0.21
132	002008	大族激光	203,911	7,330,600.45	0.21
133	600383	金地集团	534,800	7,326,760.00	0.21
134	002463	沪电股份	288,823	7,214,798.54	0.20
135	601138	工业富联	471,899	7,149,269.85	0.20
136	000860	顺鑫农业	124,700	7,105,406.00	0.20
137	600346	恒力石化	501,580	7,022,120.00	0.20
138	600660	福耀玻璃	333,794	6,966,280.78	0.20
139	601225	陕西煤业	951,400	6,859,594.00	0.19
140	300408	三环集团	247,208	6,847,661.60	0.19
141	601901	方正证券	955,808	6,767,120.64	0.19
142	002120	韵达股份	275,988	6,747,906.60	0.19
143	601155	新城控股	215,500	6,732,220.00	0.19
144	601877	正泰电器	254,215	6,698,565.25	0.19
145	600522	中天科技	584,500	6,692,525.00	0.19
146	300033	同花顺	50,120	6,669,969.60	0.19
147	002736	国信证券	586,800	6,630,840.00	0.19
148	000425	徐工机械	1,116,700	6,599,697.00	0.18
149	600340	华夏幸福	287,601	6,574,558.86	0.18
150	600109	国金证券	575,031	6,561,103.71	0.18
151	002202	金风科技	657,124	6,551,526.28	0.18
152	300144	宋城演艺	373,749	6,465,857.70	0.18
153	603799	华友钴业	162,240	6,304,646.40	0.18
154	601669	中国电建	1,809,362	6,260,392.52	0.18
155	000783	长江证券	920,717	6,205,632.58	0.17
156	603993	洛阳钼业	1,676,600	6,153,122.00	0.17
157	601108	财通证券	599,401	6,143,860.25	0.17
158	601800	中国交建	836,800	6,142,112.00	0.17
159	002841	视源股份	61,581	6,128,541.12	0.17
160	601555	东吴证券	738,030	6,022,324.80	0.17
161	601985	中国核电	1,467,600	6,002,484.00	0.17
162	600089	特变电工	881,784	5,969,677.68	0.17
163	000069	华侨城 A	978,700	5,930,922.00	0.17

164	603369	今世缘	148,700	5,916,773.00	0.17
165	600867	通化东宝	336,888	5,871,957.84	0.16
166	000768	中航飞机	330,771	5,867,877.54	0.16
167	600010	包钢股份	5,385,600	5,816,448.00	0.16
168	000066	中国长城	421,100	5,558,520.00	0.16
169	002493	荣盛石化	449,470	5,528,481.00	0.15
170	002916	深南电路	32,400	5,427,648.00	0.15
171	002179	中航光电	131,780	5,404,297.80	0.15
172	600606	绿地控股	867,300	5,359,914.00	0.15
173	600487	亨通光电	326,433	5,356,765.53	0.15
174	000963	华东医药	209,500	5,300,350.00	0.15
175	600029	南方航空	1,020,390	5,275,416.30	0.15
176	002157	正邦科技	299,000	5,226,520.00	0.15
177	600795	国电电力	2,804,800	5,188,880.00	0.15
178	600061	国投资本	401,977	5,117,167.21	0.14
179	000625	长安汽车	463,900	5,102,900.00	0.14
180	600705	中航资本	1,280,000	5,068,800.00	0.14
181	600886	国投电力	643,561	5,058,389.46	0.14
182	601607	上海医药	274,856	5,051,853.28	0.14
183	002422	科伦药业	239,569	5,030,949.00	0.14
184	600893	航发动力	213,980	5,024,250.40	0.14
185	600926	杭州银行	562,553	5,017,972.76	0.14
186	601100	恒立液压	62,200	4,988,440.00	0.14
187	002466	天齐锂业	212,055	4,866,662.25	0.14
188	601162	天风证券	796,830	4,828,789.80	0.14
189	601066	中信建投	122,601	4,828,027.38	0.14
190	600111	北方稀土	517,600	4,824,032.00	0.14
191	600498	烽火通信	166,200	4,804,842.00	0.13
192	603899	晨光文具	87,875	4,797,975.00	0.13
193	603658	安图生物	29,000	4,710,760.00	0.13
194	601111	中国国航	710,800	4,698,388.00	0.13
195	600637	东方明珠	486,731	4,696,954.15	0.13
196	600176	中国巨石	501,000	4,584,150.00	0.13
197	600115	东方航空	1,061,462	4,479,369.64	0.13
198	002607	中公教育	161,382	4,478,350.50	0.13
199	002601	龙蟠佰利	241,100	4,460,350.00	0.12
200	601360	三六零	241,000	4,412,710.00	0.12
201	600011	华能国际	1,044,556	4,408,026.32	0.12
202	600233	圆通速递	301,200	4,385,472.00	0.12
203	601727	上海电气	869,000	4,379,760.00	0.12
204	600118	中国卫星	141,614	4,365,959.62	0.12
205	300628	亿联网络	63,700	4,348,162.00	0.12

206	600332	白云山	134,100	4,335,453.00	0.12
207	601816	京沪高铁	695,300	4,331,719.00	0.12
208	600271	航天信息	265,724	4,315,357.76	0.12
209	000786	北新建材	202,100	4,310,793.00	0.12
210	601600	中国铝业	1,549,236	4,275,891.36	0.12
211	601618	中国中冶	1,687,300	4,235,123.00	0.12
212	003816	中国广核	1,406,600	4,163,536.00	0.12
213	000656	金科股份	510,200	4,163,232.00	0.12
214	601838	成都银行	516,300	4,109,748.00	0.12
215	600221	海航控股	2,734,000	4,101,000.00	0.11
216	002252	上海莱士	480,500	4,065,030.00	0.11
217	600489	中金黄金	442,600	4,045,364.00	0.11
218	000728	国元证券	480,900	4,039,560.00	0.11
219	000703	恒逸石化	439,880	4,016,104.40	0.11
220	601919	中远海控	1,154,800	4,007,156.00	0.11
221	600177	雅戈尔	659,812	3,932,479.52	0.11
222	000961	中南建设	439,500	3,911,550.00	0.11
223	600068	葛洲坝	655,500	3,900,225.00	0.11
224	600066	宇通客车	318,075	3,880,515.00	0.11
225	000596	古井贡酒	25,628	3,850,350.72	0.11
226	601997	贵阳银行	532,940	3,815,850.40	0.11
227	600390	五矿资本	536,720	3,789,243.20	0.11
228	601998	中信银行	731,100	3,765,165.00	0.11
229	600004	白云机场	244,200	3,721,608.00	0.10
230	601198	东兴证券	330,201	3,599,190.90	0.10
231	600085	同仁堂	131,000	3,552,720.00	0.10
232	002508	老板电器	113,700	3,537,207.00	0.10
233	601881	中国银河	308,300	3,536,201.00	0.10
234	600018	上港集团	825,800	3,468,360.00	0.10
235	600219	南山铝业	1,708,000	3,467,240.00	0.10
236	600516	方大炭素	544,418	3,418,945.04	0.10
237	002673	西部证券	417,400	3,405,984.00	0.10
238	601231	环旭电子	154,200	3,367,728.00	0.09
239	002146	荣盛发展	414,600	3,358,260.00	0.09
240	600998	九州通	179,600	3,344,152.00	0.09
241	601018	宁波港	935,200	3,338,664.00	0.09
242	600362	江西铜业	244,700	3,293,662.00	0.09
243	601319	中国人保	509,300	3,279,892.00	0.09
244	600655	豫园股份	369,600	3,274,656.00	0.09
245	600760	中航沈飞	99,500	3,265,590.00	0.09
246	603833	欧派家居	28,000	3,245,200.00	0.09
247	600170	上海建工	1,054,700	3,237,929.00	0.09

248	601117	中国化学	584,600	3,203,608.00	0.09
249	601878	浙商证券	316,700	3,138,497.00	0.09
250	600297	广汇汽车	963,857	3,074,703.83	0.09
251	600848	上海临港	143,000	3,070,210.00	0.09
252	601021	春秋航空	86,840	3,060,241.60	0.09
253	600369	西南证券	666,300	3,058,317.00	0.09
254	002773	康弘药业	61,610	3,055,856.00	0.09
255	600208	新湖中宝	1,021,400	3,043,772.00	0.09
256	002739	万达电影	198,850	3,036,439.50	0.09
257	002938	鹏鼎控股	60,000	3,003,600.00	0.08
258	002153	石基信息	75,425	2,943,837.75	0.08
259	002958	青农商行	662,300	2,933,989.00	0.08
260	600674	川投能源	312,700	2,898,729.00	0.08
261	600038	中直股份	69,400	2,850,258.00	0.08
262	601658	邮储银行	621,100	2,838,427.00	0.08
263	002939	长城证券	222,300	2,738,736.00	0.08
264	002032	苏泊尔	37,477	2,660,867.00	0.07
265	600027	华电国际	775,800	2,653,236.00	0.07
266	603156	养元饮品	120,611	2,593,136.50	0.07
267	002558	巨人网络	142,700	2,482,980.00	0.07
268	000627	天茂集团	473,612	2,467,518.52	0.07
269	000671	阳光城	389,090	2,466,830.60	0.07
270	601992	金隅集团	788,900	2,414,034.00	0.07
271	600482	中国动力	153,172	2,404,800.40	0.07
272	600583	海油工程	527,400	2,399,670.00	0.07
273	002468	申通快递	144,500	2,371,245.00	0.07
274	600977	中国电影	177,254	2,327,345.02	0.07
275	601633	长城汽车	288,904	2,230,338.88	0.06
276	000709	河钢股份	1,006,288	2,052,827.52	0.06
277	601216	君正集团	805,600	2,046,224.00	0.06
278	601238	广汽集团	222,860	2,005,740.00	0.06
279	601916	浙商银行	507,600	1,999,944.00	0.06
280	601577	长沙银行	240,600	1,910,364.00	0.05
281	601808	中海油服	141,500	1,859,310.00	0.05
282	600188	兖州煤业	211,800	1,855,368.00	0.05
283	600398	海澜之家	318,668	1,854,647.76	0.05
284	000723	美锦能源	293,000	1,834,180.00	0.05
285	601236	红塔证券	94,400	1,831,360.00	0.05
286	601698	中国卫通	95,700	1,723,557.00	0.05
287	600372	中航电子	127,400	1,696,968.00	0.05
288	600928	西安银行	319,400	1,680,044.00	0.05
289	601898	中煤能源	431,500	1,639,700.00	0.05

290	600989	宝丰能源	193,400	1,628,428.00	0.05
291	600025	华能水电	425,292	1,611,856.68	0.05
292	000708	中信特钢	83,700	1,430,433.00	0.04
293	601077	渝农商行	273,500	1,290,920.00	0.04
294	600968	海油发展	477,800	1,113,274.00	0.03
295	601828	美凯龙	95,000	1,006,050.00	0.03
296	601298	青岛港	163,900	930,952.00	0.03
297	601212	白银有色	356,300	908,565.00	0.03
298	603260	合盛硅业	32,180	879,801.20	0.02
299	002945	华林证券	63,700	879,697.00	0.02
300	600299	安迪苏	70,500	861,510.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	30,088,959.47	0.76
2	000333	美的集团	27,601,872.25	0.70
3	000858	五粮液	25,354,485.82	0.64
4	000002	万科A	20,941,429.81	0.53
5	000661	长春高新	20,234,298.67	0.51
6	601398	工商银行	16,635,076.00	0.42
7	000001	平安银行	14,001,813.00	0.36
8	002475	立讯精密	13,923,163.81	0.35
9	000725	京东方A	13,366,469.00	0.34
10	002415	海康威视	12,734,821.54	0.32
11	000063	中兴通讯	12,477,247.00	0.32
12	300498	温氏股份	12,379,685.55	0.31
13	300601	康泰生物	12,356,323.00	0.31
14	600745	闻泰科技	12,081,487.00	0.31
15	000977	浪潮信息	10,046,119.00	0.25
16	300014	亿纬锂能	9,865,360.69	0.25
17	002129	中环股份	9,617,178.18	0.24
18	002371	北方华创	9,605,089.76	0.24
19	300059	东方财富	9,389,111.41	0.24
20	002352	顺丰控股	9,129,853.04	0.23

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	42,909,720.92	1.09
2	000333	美的集团	39,503,125.13	1.00
3	000858	五粮液	38,341,715.09	0.97
4	000661	长春高新	25,058,712.01	0.64
5	000002	万科A	22,323,517.73	0.57
6	002475	立讯精密	21,224,751.70	0.54
7	000001	平安银行	20,177,737.72	0.51
8	002415	海康威视	18,238,065.88	0.46
9	300498	温氏股份	17,702,899.08	0.45
10	000725	京东方A	14,870,073.00	0.38
11	000063	中兴通讯	14,436,073.34	0.37
12	300059	东方财富	14,192,644.57	0.36
13	600519	贵州茅台	13,882,565.00	0.35
14	002714	牧原股份	13,326,132.60	0.34
15	601318	中国平安	11,813,271.00	0.30
16	601166	兴业银行	11,416,736.00	0.29
17	000100	TCL 科技	11,071,663.00	0.28
18	002304	洋河股份	11,006,702.14	0.28
19	002142	宁波银行	10,633,612.59	0.27
20	000338	潍柴动力	10,103,252.70	0.26

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	792,072,670.84
卖出股票收入（成交）总额	918,635,994.29

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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	382,370.27
2	应收证券清算款	3,380,478.84
3	应收股利	-
4	应收利息	22,122.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,784,971.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
2,195	390,393.94	844,819,486.00	98.59	12,095,215.00	1.41

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国农业银行股份有限公司 —工银瑞信沪深 300 交易型 开放式指数证券投资基金联	23,118,200.00	2.70

接基		
----	--	--

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	中国石油天然气集团有限公司	786,801,672.00	91.82
2	中信证券股份有限公司	13,643,842.00	1.59
3	中国国际金融股份有限公司	4,500,000.00	0.53
4	招商证券股份有限公司	4,187,656.00	0.49
5	中信建投证券股份有限公司	3,723,816.00	0.43
6	中国银河证券股份有限公司	3,116,098.00	0.36
7	华泰证券股份有限公司	3,100,121.00	0.36
8	方正证券股份有限公司	2,559,662.00	0.30
9	彭跃	524,534.00	0.06
10	郭翠群	393,400.00	0.05
11	中国农业银行股份有限公司—工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基	23,118,200.00	2.70

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年5月20日） 基金份额总额	6,863,688,383.00
本报告期期初基金份额总额	966,714,701.00
本报告期基金总申购份额	351,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	460,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少）	-

以“-”填列)	
本报告期末基金份额总额	856,914,701.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

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

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	1,177,390,113.50	68.88%	719,744.38	66.76%	-
银河证券	1	249,260,217.51	14.58%	157,357.57	14.60%	-
华泰证券	2	227,232,531.04	13.29%	161,630.92	14.99%	-
广发证券	3	29,753,822.31	1.74%	21,161.35	1.96%	-
中信证券	2	25,600,167.91	1.50%	18,209.47	1.69%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准:

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

(2) 选择程序

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

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	关于工银瑞信基金管理有限公司调整旗下部分 ETF 基金结算模式的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 15 日
2	关于工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金结算模式调整并相应修改托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 15 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金春节假期延长期间交易规则的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 1 月 29 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 2 月 22 日
5	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分 ETF 调整指数使用费的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 13 日
6	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分 ETF 基金新增扩位证券简称的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 16 日
7	关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 25 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 26 日

9	工银瑞信基金管理有限公司关于终止中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 26 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 11 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200101-20200630	786,801,672.00	-	-	786,801,672.00	91.82
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日