

工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	13
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遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 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	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61

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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	工银中证 500ETF
场内简称	工银 500、工银中证 500ETF
基金主代码	510530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 17 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,479,379.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	许俊
	联系电话	400-811-9999	95566
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	赵桂才	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,328,197.64
本期利润	-40,001,193.80
加权平均基金份额本期利润	-0.9329
本期加权平均净值利润率	-14.40%
本期基金份额净值增长率	-11.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	58,482,401.95
期末可供分配基金份额利润	1.4099
期末基金资产净值	273,038,944.53
期末基金份额净值	6.5825
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	27.26%

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

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

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

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

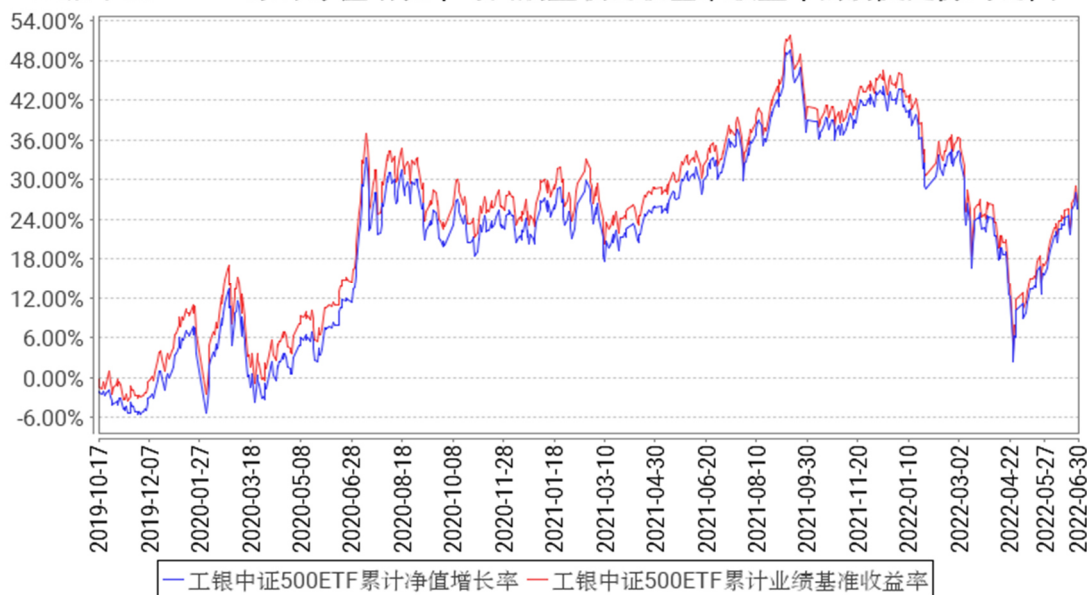
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	7.66%	1.08%	7.10%	1.10%	0.56%	-0.02%
过去三个月	2.99%	1.73%	2.04%	1.75%	0.95%	-0.02%
过去六个月	-11.44%	1.61%	-12.30%	1.63%	0.86%	-0.02%
过去一年	-4.25%	1.31%	-5.20%	1.33%	0.95%	-0.02%
自基金合同生效起至今	27.26%	1.34%	28.10%	1.36%	-0.84%	-0.02%

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

工银中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 10 月 17 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是由中国工商银行和瑞士信贷合资设立的基金管理公司，成立于 2005 年 6 月。目前，公司在北京、上海、深圳等地设有分公司，分别在香港和上海设有全资子公司-工银瑞信资产管理(国际)有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

自成立以来，公司坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足专业化、综合化、国际化、数字化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资、绿色投资、责任投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。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 7700 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 2022 年 6 月 30 日，工银瑞信(含子公司)旗下管理 216 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 1.78 万亿元，养老金管理规模居行业领先。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵栩	指数投资中心副总经理、投资总监、本基金的基金经理	2019 年 10 月 17 日	-	14 年	2008 年加入工银瑞信，现任指数投资中心副总经理、投资总监、基金经理。2011 年 10 月 18 日至今，担任上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今，担任深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今，担任工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券

				<p>投资基金联接基金基金经理； 2015 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 27 日，担任工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理；2015 年 7 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，担任工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金经理；2017 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理； 2018 年 12 月 7 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2019 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 19 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 4 月 24 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金基金经理；2020 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 7 月 24 日至 2022 年 4 月 26 日，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 9 月 28 日至今，担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 5 日至今，担任工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信深证物联网 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 6 月 30 日至今，担任工银瑞信国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 7 月 13 日至今，担任工银瑞信中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

刘琳	指数投资中心投资副总监，本基金的基金经理	2019 年 10 月 17 日	2022 年 3 月 21 日	12 年	<p>博士；2010 年加入工银瑞信，现任指数投资中心投资副总监、基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金（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，担任工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至 2022 年 3 月 21 日，担任工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金（自 2020 年 2 月 18 日起变更为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金（自 2020 年 11 月 26 日起变更为工银瑞信中证传媒指数证券投资基金（LOF））基金经理；2015 年 7 月 23 日至 2020 年 11 月 3 日，担任工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理；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 2022 年 3 月 21 日，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 2022 年 3 月 21 日，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 2022 年 3 月 21 日，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 2022 年 3 月 31 日，担任工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 21 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 1 月 22 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资</p>
----	----------------------	------------------	-----------------	------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					基金基金经理；2021 年 6 月 11 日至今，担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 22 日至今，担任工银瑞信中证科技龙头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；2021 年 8 月 5 日至今，担任工银瑞信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 11 月 26 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；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；2022 年 6 月 30 日至今，担任工银瑞信国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 7 月 4 日至今，担任工银瑞信国证新能源车电池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。
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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 6 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

2022 年上半年，市场受到了多个超预期事件的影响，整体一直处于波动之中。年初在稳增长政策的带动下，市场风格更偏向于价值，俄乌冲突的爆发，又为稳增长带来了不小的压力；二季度在疫情的超预期扰动下，产业链受到了较大的影响，基本面也同样受到了较大的冲击，部分新兴产业更是如此。进入 5 月份后，随着美联储加息缩表节奏的逐渐清晰，市场风险偏好出现了较大变化，成长风格再次主导，在疫后复产复工的带动下，国内经济重新回到逐步复苏的进程中。从整体来看，市场在 2022 年上半年，先经历了较大幅度的跌幅，下跌的幅度和速度都超出了市场的预期，5 月之后，市场出现了较大的反弹，尤其对于前期受到压制的成长型行业，市场此前较为悲观的预期出现了一些积极的变化。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-11.44%，业绩比较基准收益率为-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内稳增长形势依然严峻，稳增长的效果将决定经济复苏的进程。在地产温和改善、信用扩张幅度有限的基准情形下，市场或更多基于短期景气度进行投资，但考虑到通胀读数上行、货币难以进一步宽松，市场可能较难出现全面上涨态势。受益于稳增长政策的消费领域在经历过较为充分的风险释放之后，也有望确认底部区域并形成结构性行情，新兴产业中热点赛道或继续保持较好的景气度，但可能存在一定程度的分化。下半年海外因素对于市场也将形成一定程度的制约，一方面是美联储加息缩表的进程对于全球资产的影响可能进一步加深，另一方面，美股如果出现系统性风险，对于新兴市场既有负面冲击但也存在一定机会。总的来看，我们认为下半年权益市场可能仍然会以波动为主，景气度相对较高和投资性价比相对较高的板块更容易得到市场的关注和配置。

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

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有

关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,975,212.42	3,310,260.82
结算备付金		1,020.00	40,789.51
存出保证金		28,159.33	18,612.54
交易性金融资产	6.4.7.2	268,824,621.91	360,793,297.17
其中：股票投资		268,524,288.29	360,742,486.87
基金投资		-	-
债券投资		300,333.62	50,810.30
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		-	816,102.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	393.85
资产总计		273,829,013.66	364,979,456.15
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		95,564.90	139,361.31
应付托管费		14,865.66	21,678.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.01	0.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	679,637.16	775,269.88
负债合计		790,069.13	936,309.63
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	214,556,542.58	253,351,098.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	58,482,401.95	110,692,048.48
净资产合计		273,038,944.53	364,043,146.52
负债和净资产总计		273,829,013.66	364,979,456.15

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日。

2、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 6.5825 元，基金份额总额为 41,479,379.00 份。

3、比较数据已根据《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额，下同。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-39,076,297.30	25,486,950.02
1. 利息收入		7,005.81	8,417.74
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,005.81	8,417.74
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）		-2,511,522.03	19,136,240.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,436,498.71	16,433,866.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	6,531.68	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
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	2,918,445.00	2,702,373.87
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	-36,672,996.16	6,192,996.38
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	101,215.08	149,295.22
减：二、营业总支出		924,896.50	1,235,221.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	622,655.39	701,268.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	96,857.48	109,086.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.31	-
8. 其他费用	6.4.7.23	205,383.32	424,867.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40,001,193.80	24,251,728.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40,001,193.80	24,251,728.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-40,001,193.80	24,251,728.05

注：比较数据已根据《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额，下同。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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）	253,351,098.04	-	110,692,048.48	364,043,146.52
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）	253,351,098.04	-	110,692,048.48	364,043,146.52
三、本期增减变动额（减少）	-38,794,555.46	-	-52,209,646.53	-91,004,201.99

以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-40,001,193.80	-40,001,193.80
(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)	-38,794,555.46	-	-12,208,452.73	-51,003,008.19
其中：1. 基金申购款	12,931,518.49	-	3,049,073.26	15,980,591.75
2. 基金赎回款	-51,726,073.95	-	-15,257,525.99	-66,983,599.94
(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)	214,556,542.58	-	58,482,401.95	273,038,944.53
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	261,110,009.13	-	61,299,036.96	322,409,046.09

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产（基金净值）	261,110,009.13	-	61,299,036.96	322,409,046.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,931,518.50	-	20,367,854.32	7,436,335.82
（一）、综合收益总额	-	-	24,251,728.05	24,251,728.05
（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）	-12,931,518.50	-	-3,883,873.73	-16,815,392.23
其中：1. 基金申购款	43,967,162.86	-	10,919,369.95	54,886,532.81
2. 基金赎回款	-56,898,681.36	-	-14,803,243.68	-71,701,925.04
（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、本期末净资产（基金净值）	248,178,490.63	-	81,666,891.28	329,845,381.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]220 号《关于准予工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,• 存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,080,938,281.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0550 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,080,968,281.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 30,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

1、金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的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,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

3、收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或者发行价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利息收入。

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。

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。

6.4.5 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期初未分配利润。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

1、金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具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。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求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 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金

融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示。同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金持有的金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的具体结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购和其他资产，金额分别为 3,310,260.82 元、40,789.51 元、18,612.54 元、0.00 元、816,102.26 元、393.85 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、其他资产-应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 3,310,617.04 元、40,809.75 元、18,621.78 元、0.00 元、816,102.26 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元、0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 360,793,297.17 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 360,793,305.32 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为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、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，金额分别为 0.00 元、0.00 元、0.00 元、139,361.31 元、21,678.42 元、0.00 元、89,729.81 元、0.00 元、685,540.07 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.00 元、0.00 元、0.00 元、139,361.31 元、21,678.42 元、0.00 元、89,729.81 元、0.00 元、685,540.07 元。

2、修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,975,212.42
等于：本金	4,974,788.49
加：应计利息	423.93
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,975,212.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	280,835,095.97	-	268,524,288.29	-12,310,807.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	149.72	300,333.62	55,383.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	149.72	300,333.62	55,383.90
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	281,079,895.97	149.72	268,824,621.91	-12,255,423.78

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货投资。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	59,724.56
其中：交易所市场	59,724.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
应退替代款	311,413.47
可退替代款	4,608.00
指数使用费	70,000.00
IOPV 服务费	149,588.57
合计	679,637.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,979,379.00	253,351,098.04
本期申购	2,500,000.00	12,931,518.49
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000,000.00	-51,726,073.95
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	41,479,379.00	214,556,542.58

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	123,369,727.26	-12,677,678.78	110,692,048.48

本期利润	-3,328,197.64	-36,672,996.16	-40,001,193.80
本期基金份额交易产生的变动数	-18,800,003.60	6,591,550.87	-12,208,452.73
其中：基金申购款	6,095,011.45	-3,045,938.19	3,049,073.26
基金赎回款	-24,895,015.05	9,637,489.06	-15,257,525.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,241,526.02	-42,759,124.07	58,482,401.95

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		5,630.44
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		1,177.16
其他		198.21
合计		7,005.81

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	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-5,392,959.05
股票投资收益——赎回差价收入		-43,539.66
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		-5,436,498.71

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	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		75,495,268.01
减：卖出股票成本总额		80,724,406.01
减：交易费用		163,821.05
买卖股票差价收入		-5,392,959.05

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	66,983,599.94
减：现金支付赎回款总额	33,297,711.94
减：赎回股票成本总额	33,729,427.66
减：交易费用	-
赎回差价收入	-43,539.66

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	141.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,389.94
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	6,531.68

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,893.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,500.00
减：应计利息总额	2.68
减：交易费用	1.00
买卖债券差价收入	6,389.94

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,918,445.00
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	2,918,445.00

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-36,672,996.16
股票投资	-36,721,569.76
债券投资	48,573.60
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	-36,672,996.16

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	101,215.08
合计	101,215.08

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,484.84
指数使用费	70,000.00
存托服务费	7.35
IOPV 服务费	49,588.57
合计	205,383.32

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	622,655.39	701,268.66
其中：支付销售机构的客户维护 费	62,948.16	3,970.45

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，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	96,857.48	109,086.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.07% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	9,465,600.00	22.82	17,593,000.00	35.92

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,975,212.42	5,630.44	3,897,737.48	5,804.09

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(2022 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

6.4.12.1.2 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
127064	杭氧转债	2022 年 5 月 20 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.02	191	19,100.00	19,103.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	--------	-----------	--------	--------	----

				价						
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项	9.60	2022年7月14日	9.99	49,300	521,384.12	473,280.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、信用风险管理团队、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，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、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部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等，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，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

(3) 稽核团队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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	300,333.62	50,810.30
未评级	-	-
合计	300,333.62	50,810.30

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

赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	4,975,212.42	-	-	-	4,975,212.42
结算备付金	1,020.00	-	-	-	1,020.00
存出保证金	28,159.33	-	-	-	28,159.33
交易性金融资产	-	-	300,333.62	268,524,288.29	268,824,621.91
资产总计	5,004,391.75	-	300,333.62	268,524,288.29	273,829,013.66
负债					
应付清算款	-	-	-	0.40	0.40
应付管理人报酬	-	-	-	95,564.90	95,564.90
应付托管费	-	-	-	14,865.66	14,865.66
应交税费	-	-	-	1.01	1.01
其他负债	-	-	-	679,637.16	679,637.16
负债总计	-	-	-	790,069.13	790,069.13
利率敏感度缺口	5,004,391.75	-	300,333.62	267,734,219.16	273,038,944.53
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,310,260.82	-	-	-	3,310,260.82
结算备付金	40,789.51	-	-	-	40,789.51
存出保证金	18,612.54	-	-	-	18,612.54
交易性金融资产	-	-	50,810.30	360,742,486.87	360,793,297.17
应收清算款	-	-	-	816,102.26	816,102.26
其他资产	-	-	-	393.85	393.85

资产总计	3,369,662.87	-	50,810.30	361,558,982.98	364,979,456.15
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	139,361.31	139,361.31
应付托管费	-	-	-	21,678.42	21,678.42
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	775,269.88	775,269.88
负债总计	-	-	-	936,309.63	936,309.63
利率敏感度缺口	3,369,662.87	-	50,810.30	360,622,673.35	364,043,146.52

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	利率增加 25 基点	-4,222.82	-733.81
	利率减少 25 基点	4,294.41	746.53

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	268,524,288.29	98.35	360,742,486.87	99.09
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	300,333.62	0.11	50,810.30	0.01
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	268,824,621.91	98.46	360,793,297.17	99.11

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	13,534,642.40	17,987,147.88
	业绩比较基准减少 5%	-13,534,642.40	-17,987,147.88

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	268,332,238.31	360,766,792.68
第二层次	492,383.60	26,504.49
第三层次	-	-
合计	268,824,621.91	360,793,297.17

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券等投资，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，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证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，确定相关证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

无。

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

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	268,524,288.29	98.06
	其中：股票	268,524,288.29	98.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	300,333.62	0.11
	其中：债券	300,333.62	0.11
	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	4,976,232.42	1.82
8	其他各项资产	28,159.33	0.01
9	合计	273,829,013.66	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	2,464,660.40	0.90
B	采矿业	11,945,480.30	4.38
C	制造业	159,193,617.04	58.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,292,724.40	3.04
E	建筑业	3,477,032.00	1.27
F	批发和零售业	10,442,214.92	3.82
G	交通运输、仓储和邮政业	7,168,018.58	2.63
H	住宿和餐饮业	570,400.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,822,582.86	7.26
J	金融业	23,811,795.29	8.72
K	房地产业	6,349,428.70	2.33

L	租赁和商务服务业	3,278,578.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	3,346,709.00	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,952,367.93	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	625,110.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	3,600,298.00	1.32
S	综合	1,973,382.00	0.72
	合计	268,314,399.42	98.27

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	173,001.15	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	13,518.40	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,353.00	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	16.32	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,888.87	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。

7.2.3 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	600522	中天科技	110,000	2,541,000.00	0.93
2	601615	明阳智能	68,500	2,315,300.00	0.85
3	600256	广汇能源	187,400	1,975,196.00	0.72
4	300012	华测检测	68,400	1,587,564.00	0.58
5	300769	德方纳米	3,800	1,552,984.00	0.57
6	002497	雅化集团	47,100	1,537,815.00	0.56
7	002407	多氟多	31,300	1,530,883.00	0.56
8	002180	纳思达	29,000	1,467,980.00	0.54
9	600096	云天化	46,200	1,454,376.00	0.53
10	600157	永泰能源	906,400	1,441,176.00	0.53
11	600885	宏发股份	34,122	1,428,005.70	0.52
12	000009	中国宝安	105,300	1,420,497.00	0.52
13	600141	兴发集团	31,600	1,390,084.00	0.51
14	300390	天华超净	15,600	1,363,440.00	0.50
15	002240	盛新锂能	22,500	1,358,100.00	0.50
16	300073	当升科技	14,500	1,309,930.00	0.48
17	600392	盛和资源	57,200	1,292,720.00	0.47
18	002384	东山精密	55,900	1,281,787.00	0.47
19	603613	国联股份	14,315	1,268,309.00	0.46
20	002756	永兴材料	8,300	1,263,343.00	0.46
21	600418	江淮汽车	71,300	1,223,508.00	0.45
22	300285	国瓷材料	32,800	1,178,176.00	0.43
23	600765	中航重机	35,920	1,155,905.60	0.42
24	600399	抚顺特钢	64,300	1,150,970.00	0.42
25	600563	法拉电子	5,600	1,148,896.00	0.42
26	600233	圆通速递	56,100	1,143,879.00	0.42

27	601555	东吴证券	163,420	1,132,500.60	0.41
28	601058	赛轮轮胎	99,800	1,124,746.00	0.41
29	300037	新宙邦	21,340	1,121,630.40	0.41
30	600487	亨通光电	77,000	1,119,580.00	0.41
31	000983	山西焦煤	83,480	1,117,797.20	0.41
32	600499	科达制造	54,100	1,116,624.00	0.41
33	600732	爱旭股份	33,200	1,096,264.00	0.40
34	603077	和邦生物	252,300	1,074,798.00	0.39
35	688180	君实生物	14,200	1,069,828.00	0.39
36	002385	大北农	135,200	1,055,912.00	0.39
37	300363	博腾股份	13,400	1,045,066.00	0.38
38	601108	财通证券	132,600	1,043,562.00	0.38
39	603456	九洲药业	20,100	1,039,170.00	0.38
40	002268	卫士通	24,151	1,036,319.41	0.38
41	603345	安井食品	6,100	1,024,007.00	0.38
42	600486	扬农化工	7,600	1,012,928.00	0.37
43	688122	西部超导	10,984	1,012,724.80	0.37
44	000519	中兵红箭	34,100	994,015.00	0.36
45	688099	晶晨股份	9,801	989,901.00	0.36
46	600298	安琪酵母	20,200	984,750.00	0.36
47	300144	宋城演艺	64,000	982,400.00	0.36
48	000630	铜陵有色	300,400	979,304.00	0.36
49	600862	中航高科	34,100	958,210.00	0.35
50	000988	华工科技	41,000	949,970.00	0.35
51	002353	杰瑞股份	23,500	947,050.00	0.35
52	603605	珀莱雅	5,729	946,316.22	0.35
53	000783	长江证券	157,600	934,568.00	0.34
54	601077	渝农商行	252,400	933,880.00	0.34
55	601168	西部矿业	77,800	920,374.00	0.34
56	002625	光启技术	52,500	906,675.00	0.33
57	601696	中银证券	67,800	901,740.00	0.33
58	300146	汤臣倍健	41,600	900,640.00	0.33
59	601162	天风证券	282,600	898,668.00	0.33
60	002028	思源电气	24,814	884,867.24	0.32
61	300724	捷佳伟创	9,900	884,565.00	0.32
62	002056	横店东磁	33,100	881,122.00	0.32
63	002797	第一创业	137,300	880,093.00	0.32
64	002507	涪陵榨菜	25,300	873,356.00	0.32
65	603517	绝味食品	15,100	873,082.00	0.32
66	600988	赤峰黄金	54,400	867,680.00	0.32
67	603589	口子窖	14,800	867,428.00	0.32
68	000932	华菱钢铁	169,100	860,719.00	0.32

69	002185	华天科技	91,300	856,394.00	0.31
70	601128	常熟银行	111,794	854,106.16	0.31
71	688777	中控技术	11,700	851,292.00	0.31
72	603026	石大胜华	5,800	843,030.00	0.31
73	601636	旗滨集团	65,700	837,675.00	0.31
74	600521	华海药业	36,400	826,280.00	0.30
75	600039	四川路桥	78,400	825,552.00	0.30
76	002603	以岭药业	33,920	824,256.00	0.30
77	002326	永太科技	25,000	823,250.00	0.30
78	601607	上海医药	45,400	820,832.00	0.30
79	600109	国金证券	91,100	819,900.00	0.30
80	000830	鲁西化工	47,100	814,359.00	0.30
81	002078	太阳纸业	65,700	808,767.00	0.30
82	002624	完美世界	55,400	796,098.00	0.29
83	600153	建发股份	60,600	792,042.00	0.29
84	600546	山煤国际	40,400	786,184.00	0.29
85	605117	德业股份	2,800	783,692.00	0.29
86	603267	鸿远电子	5,800	779,114.00	0.29
87	603939	益丰药房	14,700	776,601.00	0.28
88	601872	招商轮船	132,300	762,048.00	0.28
89	002422	科伦药业	40,700	761,090.00	0.28
90	600348	华阳股份	48,985	757,308.10	0.28
91	600705	中航产融	218,200	754,972.00	0.28
92	600497	驰宏锌锗	145,220	753,691.80	0.28
93	300699	光威复材	12,800	753,536.00	0.28
94	000738	航发控制	26,800	753,080.00	0.28
95	601990	南京证券	90,200	752,268.00	0.28
96	600177	雅戈尔	113,400	751,842.00	0.28
97	000831	五矿稀土	24,000	750,000.00	0.27
98	600549	厦门钨业	34,600	748,052.00	0.27
99	600875	东方电气	45,400	746,830.00	0.27
100	688390	固德威	2,380	744,963.80	0.27
101	000970	中科三环	39,655	744,720.90	0.27
102	300088	长信科技	99,917	741,384.14	0.27
103	603127	昭衍新药	6,500	739,700.00	0.27
104	600160	巨化股份	55,200	725,880.00	0.27
105	300676	华大基因	10,100	724,170.00	0.27
106	000999	华润三九	16,080	723,600.00	0.27
107	600859	王府井	27,600	717,048.00	0.26
108	002138	顺络电子	26,300	716,675.00	0.26
109	002572	索菲亚	26,000	715,000.00	0.26
110	000998	隆平高科	42,900	714,714.00	0.26

111	002673	西部证券	109,100	713,514.00	0.26
112	601699	潞安环能	48,800	713,456.00	0.26
113	002557	洽洽食品	12,500	711,625.00	0.26
114	600516	方大炭素	93,000	706,800.00	0.26
115	000807	云铝股份	70,900	700,492.00	0.26
116	600143	金发科技	73,400	698,768.00	0.26
117	601997	贵阳银行	119,500	694,295.00	0.25
118	002508	老板电器	19,200	691,776.00	0.25
119	000039	中集集团	49,940	691,669.00	0.25
120	600482	中国动力	44,000	691,240.00	0.25
121	002030	达安基因	40,152	690,212.88	0.25
122	002273	水晶光电	56,700	686,637.00	0.25
123	000960	锡业股份	40,900	685,893.00	0.25
124	002465	海格通信	75,000	681,750.00	0.25
125	300357	我武生物	12,900	671,187.00	0.25
126	300136	信维通信	39,500	665,575.00	0.24
127	000629	攀钢钒钛	175,100	665,380.00	0.24
128	000728	国元证券	106,900	664,918.00	0.24
129	300058	蓝色光标	101,400	662,142.00	0.24
130	600170	上海建工	218,100	660,843.00	0.24
131	603444	吉比特	1,700	659,600.00	0.24
132	000975	银泰黄金	67,680	659,203.20	0.24
133	689009	九号公司	14,700	654,150.00	0.24
134	600704	物产中大	127,400	653,562.00	0.24
135	600536	中国软件	16,070	652,281.30	0.24
136	002092	中泰化学	84,000	651,840.00	0.24
137	601577	长沙银行	81,800	648,674.00	0.24
138	002294	信立泰	22,800	640,680.00	0.23
139	600079	人福医药	40,000	640,000.00	0.23
140	002409	雅克科技	11,489	637,754.39	0.23
141	600739	辽宁成大	43,500	634,230.00	0.23
142	603198	迎驾贡酒	9,700	631,858.00	0.23
143	300474	景嘉微	9,200	629,188.00	0.23
144	002223	鱼跃医疗	24,500	628,670.00	0.23
145	300418	昆仑万维	39,200	627,200.00	0.23
146	300244	迪安诊断	20,100	625,110.00	0.23
147	600415	小商品城	112,200	624,954.00	0.23
148	000547	航天发展	52,200	623,268.00	0.23
149	002372	伟星新材	25,900	622,636.00	0.23
150	002739	万达电影	45,600	622,440.00	0.23
151	002506	协鑫集成	167,100	621,612.00	0.23
152	000636	风华高科	33,000	620,070.00	0.23

153	300253	卫宁健康	70,200	616,356.00	0.23
154	600699	均胜电子	39,180	615,517.80	0.23
155	300558	贝达药业	10,100	614,080.00	0.22
156	300308	中际旭创	19,500	605,475.00	0.22
157	300296	利亚德	82,900	605,170.00	0.22
158	600372	中航电子	31,100	603,029.00	0.22
159	600315	上海家化	14,000	598,500.00	0.22
160	002683	广东宏大	21,500	598,345.00	0.22
161	600637	东方明珠	83,600	597,740.00	0.22
162	600867	通化东宝	57,300	592,482.00	0.22
163	002439	启明星辰	29,600	589,928.00	0.22
164	000887	中鼎股份	32,300	589,152.00	0.22
165	600985	淮北矿业	40,400	588,224.00	0.22
166	600236	桂冠电力	96,500	587,685.00	0.22
167	601016	节能风电	122,400	587,520.00	0.22
168	601198	东兴证券	65,900	586,510.00	0.21
169	300832	新产业	13,000	586,430.00	0.21
170	600026	中远海能	56,700	585,711.00	0.21
171	002156	通富微电	38,000	585,200.00	0.21
172	002299	圣农发展	30,500	584,990.00	0.21
173	600171	上海贝岭	23,300	583,199.00	0.21
174	002065	东华软件	91,500	578,280.00	0.21
175	600380	健康元	46,745	577,300.75	0.21
176	600879	航天电子	88,930	577,155.70	0.21
177	600258	首旅酒店	23,000	570,400.00	0.21
178	600642	申能股份	100,300	569,704.00	0.21
179	300026	红日药业	73,600	566,720.00	0.21
180	000750	国海证券	155,680	565,118.40	0.21
181	002936	郑州银行	209,688	564,060.72	0.21
182	002408	齐翔腾达	69,540	563,969.40	0.21
183	000623	吉林敖东	38,050	561,618.00	0.21
184	000400	许继电气	29,000	556,800.00	0.20
185	002203	海亮股份	48,200	556,710.00	0.20
186	000729	燕京啤酒	57,500	555,450.00	0.20
187	000513	丽珠集团	15,319	554,700.99	0.20
188	600673	东阳光	61,500	552,885.00	0.20
189	000878	云南铜业	48,500	552,415.00	0.20
190	600820	隧道股份	89,700	548,964.00	0.20
191	600580	卧龙电驱	37,700	543,634.00	0.20
192	601717	郑煤机	37,700	543,257.00	0.20
193	600529	山东药玻	19,300	539,435.00	0.20
194	600369	西南证券	135,700	538,729.00	0.20

195	600801	华新水泥	27,572	537,929.72	0.20
196	600038	中直股份	11,900	537,880.00	0.20
197	688185	康希诺	2,700	537,516.00	0.20
198	300017	网宿科技	99,900	535,464.00	0.20
199	603233	大参林	17,100	535,230.00	0.20
200	002183	怡亚通	74,000	533,540.00	0.20
201	300383	光环新网	51,200	533,504.00	0.20
202	002131	利欧股份	275,000	533,500.00	0.20
203	603568	伟明环保	15,930	531,584.10	0.19
204	600848	上海临港	39,200	531,552.00	0.19
205	600166	福田汽车	187,400	530,342.00	0.19
206	600316	洪都航空	17,500	529,200.00	0.19
207	002958	青农商行	158,700	526,884.00	0.19
208	002195	二三四五	233,400	525,150.00	0.19
209	300677	英科医疗	20,700	524,952.00	0.19
210	002444	巨星科技	27,800	523,752.00	0.19
211	600325	华发股份	69,100	523,087.00	0.19
212	600027	华电国际	133,100	523,083.00	0.19
213	601005	重庆钢铁	273,700	522,767.00	0.19
214	600909	华安证券	114,780	522,249.00	0.19
215	600008	首创环保	180,030	522,087.00	0.19
216	300001	特锐德	29,800	515,838.00	0.19
217	688256	寒武纪	7,900	511,130.00	0.19
218	300618	寒锐钴业	8,800	509,696.00	0.19
219	300024	机器人	50,400	508,032.00	0.19
220	000825	太钢不锈	93,000	506,850.00	0.19
221	002500	山西证券	87,800	503,972.00	0.18
222	002926	华西证券	64,253	503,743.52	0.18
223	002430	杭氧股份	16,100	503,286.00	0.18
224	000050	深天马 A	50,200	500,494.00	0.18
225	002373	千方科技	45,000	500,400.00	0.18
226	603218	日月股份	19,600	497,840.00	0.18
227	600271	航天信息	45,500	497,770.00	0.18
228	000027	深圳能源	77,640	497,672.40	0.18
229	000739	普洛药业	24,085	497,114.40	0.18
230	002250	联化科技	30,200	494,374.00	0.18
231	002212	天融信	48,400	491,260.00	0.18
232	600863	内蒙华电	133,000	485,450.00	0.18
233	601866	中远海发	161,500	484,500.00	0.18
234	600118	中国卫星	24,100	483,928.00	0.18
235	600208	新湖中宝	174,900	482,724.00	0.18
236	688521	芯原股份	9,770	482,638.00	0.18

237	688009	中国通号	105,800	479,274.00	0.18
238	002985	北摩高科	8,164	478,247.12	0.18
239	000060	中金岭南	106,700	475,882.00	0.17
240	300009	安科生物	46,848	473,633.28	0.17
241	002670	国盛金控	49,300	473,280.00	0.17
242	603156	养元饮品	20,800	472,576.00	0.17
243	002249	大洋电机	76,900	472,166.00	0.17
244	601992	金隅集团	170,400	472,008.00	0.17
245	000778	新兴铸管	97,800	471,396.00	0.17
246	600066	宇通客车	54,400	470,560.00	0.17
247	002152	广电运通	50,500	468,135.00	0.17
248	603658	安图生物	9,500	464,455.00	0.17
249	300070	碧水源	88,800	462,648.00	0.17
250	300182	捷成股份	84,100	462,550.00	0.17
251	603858	步长制药	23,300	459,243.00	0.17
252	300168	万达信息	48,400	456,896.00	0.17
253	002966	苏州银行	74,860	456,646.00	0.17
254	600998	九州通	38,300	456,153.00	0.17
255	000401	冀东水泥	43,300	455,516.00	0.17
256	300251	光线传媒	48,000	454,560.00	0.17
257	600056	中国医药	30,640	454,084.80	0.17
258	002831	裕同科技	15,300	452,115.00	0.17
259	002128	电投能源	31,400	449,648.00	0.16
260	600970	中材国际	46,400	449,616.00	0.16
261	002191	劲嘉股份	41,800	448,096.00	0.16
262	600390	五矿资本	91,500	447,435.00	0.16
263	000021	深科技	38,300	445,812.00	0.16
264	000997	新大陆	33,700	445,177.00	0.16
265	600667	太极实业	60,100	443,538.00	0.16
266	002505	鹏都农牧	129,700	439,683.00	0.16
267	300482	万孚生物	10,800	439,668.00	0.16
268	002221	东华能源	47,200	439,432.00	0.16
269	600528	中铁工业	54,400	437,920.00	0.16
270	002244	滨江集团	50,600	437,690.00	0.16
271	600021	上海电力	42,600	436,650.00	0.16
272	600062	华润双鹤	17,000	436,220.00	0.16
273	000656	金科股份	152,300	435,578.00	0.16
274	603885	吉祥航空	24,100	433,559.00	0.16
275	600827	百联股份	32,800	433,288.00	0.16
276	600839	四川长虹	150,400	433,152.00	0.16
277	600297	广汇汽车	165,500	431,955.00	0.16
278	000987	越秀金控	61,305	430,974.15	0.16

279	603707	健友股份	15,270	430,614.00	0.16
280	002396	星网锐捷	19,000	430,160.00	0.16
281	600598	北大荒	29,100	429,516.00	0.16
282	002127	南极电商	80,000	427,200.00	0.16
283	002019	亿帆医药	30,300	423,594.00	0.16
284	600498	烽火通信	29,200	422,816.00	0.15
285	600201	生物股份	46,074	422,037.84	0.15
286	600155	华创阳安	49,700	421,456.00	0.15
287	002266	浙富控股	87,657	419,877.03	0.15
288	688002	睿创微纳	10,486	416,503.92	0.15
289	000012	南玻 A	56,000	415,520.00	0.15
290	600259	广晟有色	8,200	415,330.00	0.15
291	002155	湖南黄金	34,200	415,188.00	0.15
292	600409	三友化工	50,600	414,414.00	0.15
293	000930	中粮科技	45,700	413,128.00	0.15
294	600511	国药股份	15,400	412,412.00	0.15
295	000883	湖北能源	80,300	410,333.00	0.15
296	002153	石基信息	25,680	407,541.60	0.15
297	600718	东软集团	35,300	406,303.00	0.15
298	600755	厦门国贸	53,900	404,250.00	0.15
299	603712	七一二	12,803	403,294.50	0.15
300	002511	中顺洁柔	32,200	403,144.00	0.15
301	002124	天邦食品	59,720	401,318.40	0.15
302	600060	海信视像	32,101	401,262.50	0.15
303	000686	东北证券	57,300	400,527.00	0.15
304	600959	江苏有线	122,200	398,372.00	0.15
305	600566	济川药业	14,600	396,536.00	0.15
306	600282	南钢股份	125,600	395,640.00	0.14
307	600895	张江高科	31,700	394,665.00	0.14
308	600782	新钢股份	78,100	393,624.00	0.14
309	601880	辽港股份	230,100	391,170.00	0.14
310	000581	威孚高科	20,300	390,775.00	0.14
311	601179	中国西电	83,400	390,312.00	0.14
312	000709	河钢股份	172,700	390,302.00	0.14
313	600022	山东钢铁	223,400	388,716.00	0.14
314	000690	宝新能源	88,600	388,068.00	0.14
315	600064	南京高科	35,200	387,200.00	0.14
316	002939	长城证券	38,000	386,080.00	0.14
317	600535	天士力	36,600	384,666.00	0.14
318	300376	易事特	47,200	383,264.00	0.14
319	688188	柏楚电子	1,740	382,869.60	0.14
320	601778	晶科科技	70,900	382,860.00	0.14

321	002701	奥瑞金	73,300	381,160.00	0.14
322	002002	鸿达兴业	102,000	378,420.00	0.14
323	600808	马钢股份	98,900	374,831.00	0.14
324	600037	歌华有线	39,857	374,257.23	0.14
325	600216	浙江医药	27,400	374,010.00	0.14
326	600500	中化国际	56,200	373,730.00	0.14
327	000598	兴蓉环境	73,100	373,541.00	0.14
328	300630	普利制药	10,614	373,082.10	0.14
329	002468	申通快递	31,200	371,904.00	0.14
330	002532	天山铝业	56,900	371,557.00	0.14
331	600728	佳都科技	57,300	370,158.00	0.14
332	600663	陆家嘴	35,700	369,852.00	0.14
333	600567	山鹰国际	131,500	364,255.00	0.13
334	002595	豪迈科技	16,300	364,142.00	0.13
335	600517	国网英大	69,900	362,781.00	0.13
336	603225	新凤鸣	31,300	361,202.00	0.13
337	601456	国联证券	29,400	360,738.00	0.13
338	603866	桃李面包	21,796	360,723.80	0.13
339	002004	华邦健康	64,500	359,910.00	0.13
340	300463	迈克生物	17,400	356,526.00	0.13
341	000785	居然之家	80,100	356,445.00	0.13
342	600597	光明乳业	28,000	353,640.00	0.13
343	300115	长盈精密	34,300	353,633.00	0.13
344	002429	兆驰股份	92,000	353,280.00	0.13
345	002745	木林森	36,077	352,472.29	0.13
346	300888	稳健医疗	5,300	352,450.00	0.13
347	601958	金钼股份	39,600	350,064.00	0.13
348	688208	道通科技	10,600	348,952.00	0.13
349	300166	东方国信	37,700	347,594.00	0.13
350	601860	紫金银行	119,800	343,826.00	0.13
351	601106	中国一重	111,900	343,533.00	0.13
352	688289	圣湘生物	11,564	342,410.04	0.13
353	002390	信邦制药	49,500	342,045.00	0.13
354	603927	中科软	14,600	340,472.00	0.12
355	300072	三聚环保	66,900	338,514.00	0.12
356	600398	海澜之家	70,800	336,300.00	0.12
357	600572	康恩贝	75,900	336,237.00	0.12
358	688006	杭可科技	4,779	334,816.74	0.12
359	601118	海南橡胶	69,900	334,122.00	0.12
360	600507	方大特钢	47,721	333,569.79	0.12
361	000540	中天金融	170,900	329,837.00	0.12
362	601718	际华集团	106,200	329,220.00	0.12

363	600737	中粮糖业	43,438	326,653.76	0.12
364	603883	老百姓	9,599	325,214.12	0.12
365	000937	冀中能源	43,200	322,272.00	0.12
366	600582	天地科技	67,400	322,172.00	0.12
367	000089	深圳机场	41,700	321,924.00	0.12
368	002010	传化智联	49,900	320,857.00	0.12
369	000559	万向钱潮	54,000	320,760.00	0.12
370	002368	太极股份	16,521	317,368.41	0.12
371	002048	宁波华翔	19,800	317,196.00	0.12
372	600967	内蒙一机	34,700	316,464.00	0.12
373	000898	鞍钢股份	97,700	314,594.00	0.12
374	600871	石化油服	166,200	314,118.00	0.12
375	002690	美亚光电	14,460	313,492.80	0.11
376	601000	唐山港	121,100	312,438.00	0.11
377	600435	北方导航	36,200	312,044.00	0.11
378	001914	招商积余	17,310	311,060.70	0.11
379	601568	北元集团	48,420	306,982.80	0.11
380	002110	三钢闽光	49,950	304,195.50	0.11
381	000959	首钢股份	63,800	303,688.00	0.11
382	600195	中牧股份	24,714	302,993.64	0.11
383	000156	华数传媒	37,900	302,063.00	0.11
384	600556	天下秀	36,700	302,041.00	0.11
385	002233	塔牌集团	34,100	301,785.00	0.11
386	601333	广深铁路	138,200	301,276.00	0.11
387	002281	光迅科技	17,000	298,860.00	0.11
388	002705	新宝股份	13,582	298,668.18	0.11
389	000537	广宇发展	22,800	296,172.00	0.11
390	600811	东方集团	104,400	295,452.00	0.11
391	003035	南网能源	46,500	295,275.00	0.11
392	002174	游族网络	30,000	293,100.00	0.11
393	600764	中国海防	11,500	290,260.00	0.11
394	000402	金融街	48,680	289,646.00	0.11
395	688321	微芯生物	11,300	284,647.00	0.10
396	600120	浙江东方	70,834	284,044.34	0.10
397	600126	杭钢股份	55,400	283,648.00	0.10
398	300212	易华录	16,260	282,924.00	0.10
399	603638	艾迪精密	13,800	282,900.00	0.10
400	600329	达仁堂	11,489	282,399.62	0.10
401	000488	晨鸣纸业	50,000	282,000.00	0.10
402	002416	爱施德	30,300	281,790.00	0.10
403	600167	联美控股	37,500	280,875.00	0.10
404	000990	诚志股份	25,500	279,225.00	0.10

405	601098	中南传媒	29,500	278,480.00	0.10
406	600446	金证股份	26,800	278,184.00	0.10
407	002925	盈趣科技	12,880	277,177.60	0.10
408	601200	上海环境	27,230	276,656.80	0.10
409	002867	周大生	17,800	276,434.00	0.10
410	002382	蓝帆医疗	28,900	275,995.00	0.10
411	002081	金螳螂	54,300	275,844.00	0.10
412	000685	中山公用	35,900	275,712.00	0.10
413	000158	常山北明	45,800	274,800.00	0.10
414	600373	中文传媒	27,500	274,725.00	0.10
415	600707	彩虹股份	58,500	273,780.00	0.10
416	601611	中国核建	32,500	272,675.00	0.10
417	601608	中信重工	71,200	269,848.00	0.10
418	002399	海普瑞	15,300	268,974.00	0.10
419	600095	湘财股份	34,900	268,381.00	0.10
420	002146	荣盛发展	88,500	268,155.00	0.10
421	001965	招商公路	35,100	267,813.00	0.10
422	002387	维信诺	39,563	265,863.36	0.10
423	603317	天味食品	9,242	263,119.74	0.10
424	002948	青岛银行	72,320	261,798.40	0.10
425	000967	盈峰环境	51,700	261,602.00	0.10
426	600131	国网信通	19,400	260,930.00	0.10
427	000528	柳 工	39,800	259,098.00	0.09
428	600376	首开股份	52,700	258,757.00	0.09
429	688029	南微医学	2,960	258,112.00	0.09
430	600623	华谊集团	30,935	256,760.50	0.09
431	601187	厦门银行	42,900	255,684.00	0.09
432	603000	人民网	22,700	254,240.00	0.09
433	002423	中粮资本	37,800	253,638.00	0.09
434	000563	陕国投 A	81,200	253,344.00	0.09
435	688088	虹软科技	8,009	253,004.31	0.09
436	601598	中国外运	64,400	249,872.00	0.09
437	600901	江苏租赁	48,600	249,318.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	127,600	247,544.00	0.09
439	600006	东风汽车	32,600	246,130.00	0.09
440	601991	大唐发电	101,200	245,916.00	0.09
441	300257	开山股份	16,200	242,352.00	0.09
442	603228	景旺电子	10,380	242,165.40	0.09
443	600906	财达证券	26,500	238,235.00	0.09
444	000961	中南建设	77,900	237,595.00	0.09
445	600717	天津港	58,938	236,341.38	0.09
446	603650	彤程新材	7,200	234,576.00	0.09

447	002242	九阳股份	12,700	233,172.00	0.09
448	002434	万里扬	26,800	229,140.00	0.08
449	000718	苏宁环球	61,700	227,056.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	31,200	223,080.00	0.08
451	000671	阳光城	101,200	221,628.00	0.08
452	000415	渤海租赁	100,600	218,302.00	0.08
453	600968	海油发展	83,300	214,914.00	0.08
454	000553	安道麦 A	17,625	213,438.75	0.08
455	601969	海南矿业	24,800	213,032.00	0.08
456	000031	大悦城	52,300	209,200.00	0.08
457	600648	外高桥	15,300	208,080.00	0.08
458	600787	中储股份	35,500	201,995.00	0.07
459	600928	西安银行	54,600	200,382.00	0.07
460	600339	中油工程	68,100	196,809.00	0.07
461	002563	森马服饰	32,900	194,768.00	0.07
462	300869	康泰医学	6,600	186,516.00	0.07
463	002815	崇达技术	14,436	184,925.16	0.07
464	000028	国药一致	6,200	184,698.00	0.07
465	601228	广州港	50,300	184,601.00	0.07
466	600835	上海机电	13,200	181,236.00	0.07
467	600377	宁沪高速	20,200	173,114.00	0.06
468	688819	天能股份	5,000	172,900.00	0.06
469	000717	韶钢松山	49,100	171,850.00	0.06
470	603056	德邦股份	12,700	170,561.00	0.06
471	603379	三美股份	7,500	166,875.00	0.06
472	000869	张裕 A	5,600	166,544.00	0.06
473	002945	华林证券	10,800	164,700.00	0.06
474	000062	深圳华强	12,900	163,830.00	0.06
475	601139	深圳燃气	23,400	162,396.00	0.06
476	601869	长飞光纤	5,119	158,279.48	0.06
477	600299	安迪苏	16,400	157,112.00	0.06
478	601298	青岛港	28,300	154,801.00	0.06
479	603868	飞科电器	1,900	143,925.00	0.05
480	001872	招商港口	9,202	143,551.20	0.05
481	601156	东航物流	7,200	142,560.00	0.05
482	300741	华宝股份	5,100	141,882.00	0.05
483	002653	海思科	8,700	140,157.00	0.05
484	600823	世茂股份	46,300	137,974.00	0.05
485	601828	美凯龙	22,300	135,138.00	0.05
486	600350	山东高速	25,600	134,400.00	0.05
487	600927	永安期货	6,600	133,122.00	0.05
488	001227	兰州银行	25,600	125,952.00	0.05

489	603355	莱克电气	4,860	122,617.80	0.04
490	603515	欧普照明	6,300	109,935.00	0.04
491	603786	科博达	1,700	104,669.00	0.04
492	001203	大中矿业	9,100	102,830.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	20,600	100,528.00	0.04
494	603719	良品铺子	3,200	91,616.00	0.03
495	002946	新乳业	7,000	90,930.00	0.03
496	601003	柳钢股份	21,000	85,050.00	0.03
497	600956	新天绿能	5,800	71,456.00	0.03
498	002901	大博医疗	1,780	69,669.20	0.03
499	603983	丸美股份	2,100	56,280.00	0.02
500	600917	重庆燃气	7,000	50,540.00	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

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	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
2	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
3	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.01
4	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.01
5	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
6	603070	万控智造	775	16,197.50	0.01
7	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.01
8	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
9	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
10	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
11	600266	城建发展	4	16.32	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	1,548,363.00	0.43
2	002497	雅化集团	1,528,918.00	0.42
3	300769	德方纳米	1,428,578.00	0.39
4	600096	云天化	1,390,345.00	0.38
5	002240	盛新锂能	1,354,860.00	0.37
6	002407	多氟多	1,272,905.00	0.35
7	300390	天华超净	1,192,287.00	0.33
8	300073	当升科技	1,187,558.22	0.33
9	688180	君实生物	1,167,842.20	0.32
10	002756	永兴材料	1,151,715.00	0.32

11	601058	赛轮轮胎	1,091,452.00	0.30
12	688122	西部超导	989,107.48	0.27
13	601108	财通证券	965,915.50	0.27
14	688777	中控技术	947,291.85	0.26
15	000783	长江证券	932,336.83	0.26
16	601162	天风证券	876,781.31	0.24
17	601696	中银证券	874,736.00	0.24
18	600499	科达制造	870,565.00	0.24
19	002625	光启技术	856,170.00	0.24
20	603345	安井食品	823,912.00	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	000733	振华科技	2,264,211.00	0.62
2	002340	格林美	2,046,092.00	0.56
3	300751	迈为股份	1,717,544.00	0.47
4	000723	美锦能源	1,639,130.00	0.45
5	600188	兖矿能源	1,567,175.00	0.43
6	601117	中国化学	1,295,677.00	0.36
7	688005	容百科技	1,259,963.18	0.35
8	300763	锦浪科技	1,243,972.00	0.34
9	002013	中航机电	1,235,894.00	0.34
10	600884	杉杉股份	1,178,272.80	0.32
11	605358	立昂微	1,113,561.00	0.31
12	601689	拓普集团	1,095,488.00	0.30
13	600754	锦江酒店	1,016,140.00	0.28
14	603290	斯达半导	938,491.00	0.26
15	300223	北京君正	934,328.00	0.26
16	002080	中材科技	845,710.00	0.23
17	688536	思瑞浦	774,126.71	0.21
18	600733	北汽蓝谷	725,154.00	0.20
19	600803	新奥股份	633,923.00	0.17
20	601975	招商南油	597,142.00	0.16

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	51,015,813.01
卖出股票收入（成交）总额	75,495,268.01

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）	300,333.62	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	300,333.62	0.11

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	127061	美锦转债	905	107,484.44	0.04
2	127058	科伦转债	742	96,902.25	0.04
3	113634	珀莱转债	210	29,356.91	0.01
4	113633	科沃转债	230	27,305.61	0.01
5	113644	艾迪转债	170	20,180.81	0.01

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

本报告期，本基金持有中天科技，其发行主体因信息披露虚假或严重误导性陈述，被上海证券交易所予以监管关注。

本基金对上述股票的投资属于跟踪标的指数的被动投资，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	28,159.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,159.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113634	珀莱转债	29,356.91	0.01
2	113633	科沃转债	27,305.61	0.01

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

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 (%)
457	90,764.51	40,176,068.00	96.86	1,303,311.00	3.14

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

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国银行股份有限公司-工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	9,465,600.00	22.82

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	国开金融有限责任公司	28,282,724.00	68.19
2	招商证券股份有限公司	986,043.00	2.38
3	中信证券股份有限公司	517,889.00	1.25
4	广发证券股份有限公司	350,154.00	0.84
5	华泰证券股份有限公司	199,358.00	0.48
6	中信建投证券股份有限公司	160,200.00	0.39
7	海通证券股份有限公司	118,500.00	0.29

8	平安资管—邮储银行—如意 36 号资产管理产品	95,400.00	0.23
9	梁华明	60,063.00	0.14
10	陈世友	53,566.00	0.13
11	中国银行股份有限公司-工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	9,465,600.00	22.82

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年10月17日)基金份额总额	1,080,968,281.00
本报告期期初基金份额总额	48,979,379.00
本报告期基金总申购份额	2,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,479,379.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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 (%)	
东方证券	1	45,625,749.98	36.16	28,354.41	36.31	-
中信证券	2	40,534,008.00	32.13	24,871.30	31.85	-
招商证券	1	39,854,546.73	31.59	24,760.71	31.71	-
海通证券	1	117,431.06	0.09	71.77	0.09	-
银河证券	2	38,631.69	0.03	26.29	0.03	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

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

(1) 选择标准：

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

(2) 选择程序

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

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	24,893.62	100.00	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 1 月 1 日
2	关于工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 3 月 23 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 6 月 17 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

	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

投资者类别	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	20220101-20220630	17,593,000.00	26,433,000.00	34,560,400.00	9,465,600.00	22.82
	2	20220101-20220630	28,282,724.00	-	-	28,282,724.00	68.19
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中, 存在基金规模大幅波动的风险, 以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

注：1、期初份额为上期期末或基金合同公告生效日当天份额。

2、期间申购份额：含买入、红利再投、转换入份额；期间赎回份额：含卖出、转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日