
工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强
型证券投资基金
2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证 500 六个月持有指数增强
基金主代码	014133
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 14 日
报告期末基金份额总额	243,114,184.79 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平

	高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，长期来看，本基金具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金如果投资港股通投资标的的股票，还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014133	014134
报告期末下属分级基金的份额总额	155,331,501.82 份	87,782,682.97 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	工银中证 500 六个月持有指数增强 A	工银中证 500 六个月持有指数增强 C
1. 本期已实现收益	-2,860,013.53	-1,713,519.16
2. 本期利润	-6,719,662.01	-3,931,481.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0425	-0.0435
4. 期末基金资产净值	138,523,417.75	77,802,001.64
5. 期末基金份额净值	0.8918	0.8863

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、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

工银中证 500 六个月持有指数增强 A

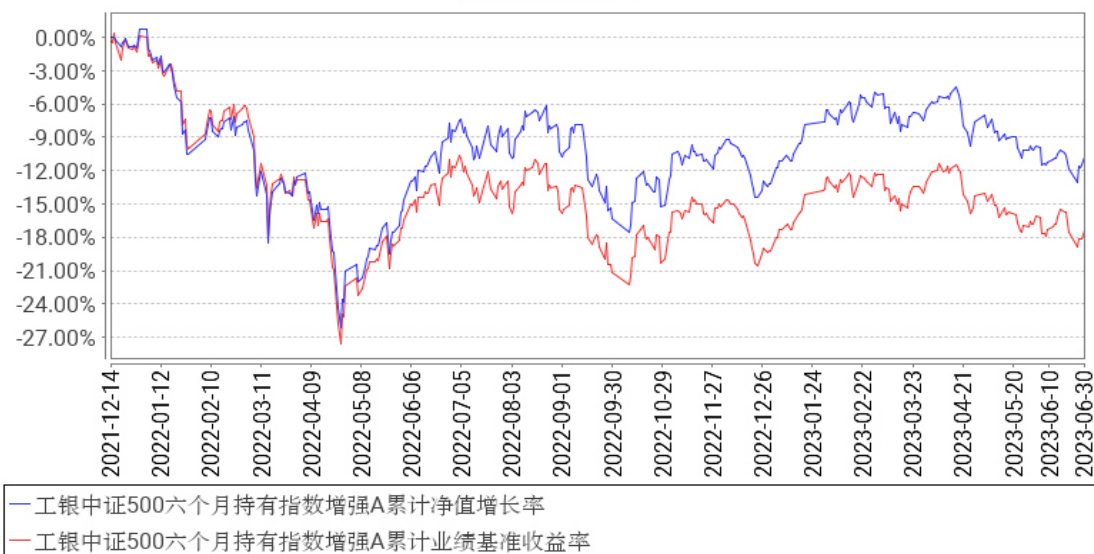
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.61%	0.71%	-5.10%	0.78%	0.49%	-0.07%
过去六个月	2.69%	0.71%	2.20%	0.75%	0.49%	-0.04%
过去一年	-2.71%	0.89%	-6.65%	0.91%	3.94%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-10.82%	1.11%	-17.45%	1.14%	6.63%	-0.03%

工银中证 500 六个月持有指数增强 C

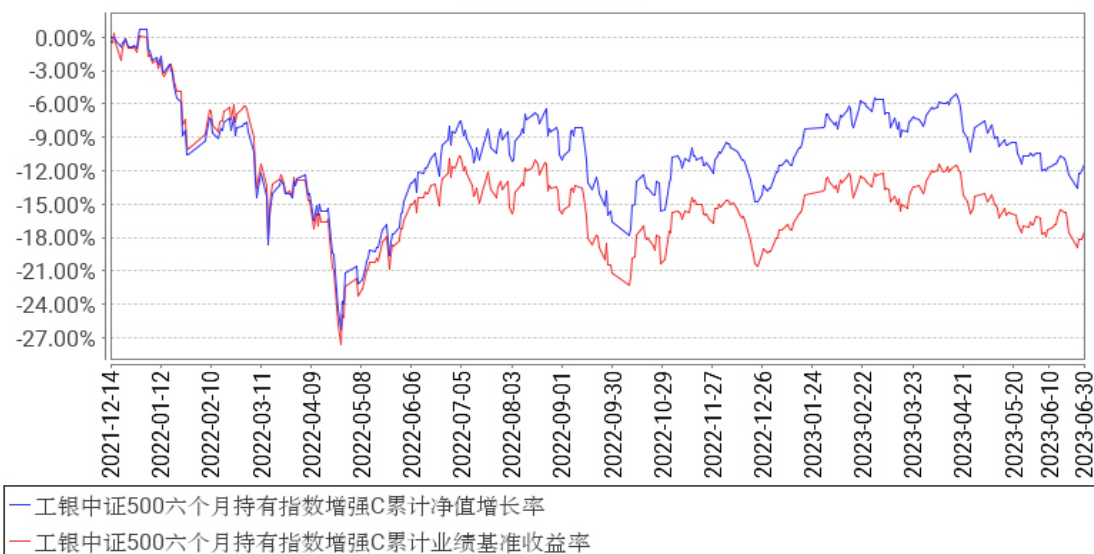
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.71%	0.71%	-5.10%	0.78%	0.39%	-0.07%
过去六个月	2.50%	0.71%	2.20%	0.75%	0.30%	-0.04%
过去一年	-3.09%	0.89%	-6.65%	0.91%	3.56%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-11.37%	1.11%	-17.45%	1.14%	6.08%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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500六个月持有指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



工银中证500六个月持有指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 12 月 14 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
邓皓友	本基金的基金经理	2021 年 12 月 14 日	-	9 年	硕士研究生。曾在瀚华金控股份有限公司担任数据分析师；2014 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2019 年 10 月 29 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 29 日至今，担任工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至 2023 年 3 月 29 日，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证消费服务领先交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 24 日至今，担任工银瑞信大和日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信中证 180ESG 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2023 年 3 月 28 日至今，担任工银瑞信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理。
刘伟琳	指数及量化投资部投资副总监、本基金的基金经理	2021 年 12 月 14 日	-	13 年	博士研究生。2010 年加入工银瑞信，曾任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数及量化投资部投资副总监、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，转型为工银瑞信中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；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；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

				<p>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 日至今, 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 2023 年 1 月 5 日, 担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理; 2021 年 6 月 11 日至 2022 年 10 月 25 日, 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 2023 年 3 月 8 日, 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 2023 年 1 月 5 日, 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</p>
--	--	--	--	---

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

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《基金从业人员资格管理规则》的相关规定。

4.1.1 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。中证 500 指数成份股由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

经济增长方面，二季度实体经济增长修复不及预期，价格指数同比回落：4-6 月制造业 PMI 持续低于 50%荣枯线，显示制造业处于收缩状态；服务业 PMI 虽仍处于荣枯线以上，但环比持续回落，显示服务业修复斜率放缓。通货膨胀角度，二季度物价水平延续疲软，4-5 月 CPI 同比增速均低于 0.2%，4-5 月 PPI 同比增速均值为-4.1%，两者均处于历史较低分位数。二季度经济修复疲弱，从直接原因上来看，地产和外需不振是主要原因，企业、居民、财政仍然难以形成收入及就业改善-预期改善-投资消费改善的正向循环。

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

股市方面，二季度 A 股行业表现分化明显，AI 相关板块涨幅靠前。二季度市场整体承压，但是仍有部分行业表现较好，这些行业主要是 AI 相关板块以及低估值盈利改善的行业。回顾二季度 A 股市场表现，主要宽基指数均收跌，其中上证综指下跌 2.2%，沪深 300 指数下跌 5.1%，深证成指下跌 6.0%。从风格来看，代表大盘股的中证 100 指数和代表中盘指数的中证 200 回报分别为-5.8%和-4.3%，中小板指和创业板指回报分别为-7.3%和-7.7%。分行业来看，各行业涨跌幅分化较大，通信、家电、传媒表现排名前三，收益率分别为 12.8%、7.1%和 6.9%，消费者服务、食品饮料、农林牧渔回报列最后三位，分别为-23.9%、-11.3%和-10.7%。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-4.61%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为-5.10%，本基金 C 份额净值增长率为-4.71%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-5.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	202,855,568.90	93.58
	其中：股票	202,855,568.90	93.58
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	13,906,882.86	6.42
8	其他资产	4,142.92	0.00
9	合计	216,766,594.68	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,671,582.00	0.77
B	采矿业	7,935,602.50	3.67
C	制造业	101,872,563.85	47.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,100,369.00	3.74
E	建筑业	1,503,225.00	0.69
F	批发和零售业	5,742,104.00	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	5,869,573.00	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	12,065,544.78	5.58

	务业		
J	金融业	15,797,193.00	7.30
K	房地产业	3,694,603.00	1.71
L	租赁和商务服务业	1,721,260.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	209,578.00	0.10
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	1,065,900.00	0.49
S	综合	2,219,673.00	1.03
	合计	169,468,771.13	78.34

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。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,476,744.00	0.68
C	制造业	22,562,675.78	10.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	1,812,980.55	0.84
F	批发和零售业	26,678.74	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,808,201.77	2.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	938,578.00	0.43
L	租赁和商务服务业	1,689,415.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	7,067.56	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	12,153.78	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,855.12	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,386,797.77	15.43

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。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	600079	人福医药	87,100	2,346,474.00	1.08
2	002600	领益智造	332,300	2,296,193.00	1.06
3	600511	国药股份	58,400	2,268,840.00	1.05
4	002745	木林森	245,900	2,262,280.00	1.05
5	002465	海格通信	218,700	2,261,358.00	1.05
6	002595	豪迈科技	64,200	2,255,346.00	1.04
7	002867	周大生	126,800	2,254,504.00	1.04
8	002128	电投能源	169,400	2,239,468.00	1.04
9	002019	亿帆医药	153,300	2,238,180.00	1.03
10	000581	威孚高科	142,100	2,238,075.00	1.03

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	301106	骏成科技	62,700	2,233,374.00	1.03
2	605258	协和电子	71,500	1,857,570.00	0.86
3	600768	宁波富邦	169,700	1,841,245.00	0.85
4	605155	西大门	125,400	1,819,554.00	0.84
5	300719	安达维尔	128,600	1,815,832.00	0.84

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,142.92
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	4,142.92

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银中证 500 六个月持有 指数增强 A	工银中证 500 六个月持有 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	166,235,151.46	94,413,705.93
报告期期间基金总申购份额	2,105,096.79	1,014,773.45
减：报告期期间基金总赎回份额	13,008,746.43	7,645,796.41
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	155,331,501.82	87,782,682.97

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信中证 500 六个月持有期指数增强型证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。

工银瑞信基金管理有限公司

2023 年 7 月 20 日