

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券
投资基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58

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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 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	1,142,214,701.00 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 9 层甲 5 号 901	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031

法定代表人	赵桂才	谷澍
-------	-----	----

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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-49,826,857.84
本期利润	89,002,149.54
加权平均基金份额本期利润	0.1056
本期加权平均净值利润率	2.80%
本期基金份额净值增长率	2.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-265,121,610.83
期末可供分配基金份额利润	-0.2321
期末基金资产净值	4,090,048,517.75
期末基金份额净值	3.5808
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.18%

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	-2.55%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.75%	0.00%
过去三个月	-1.06%	0.75%	-2.14%	0.76%	1.08%	-0.01%
过去六个月	2.03%	0.89%	0.89%	0.90%	1.14%	-0.01%
过去一年	-7.75%	0.86%	-9.91%	0.87%	2.16%	-0.01%
过去三年	-28.82%	1.03%	-33.74%	1.05%	4.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-1.18%	1.13%	-5.13%	1.14%	3.95%	-0.01%

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。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中国工商银行控股的基金管理公司，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。目前，公司（含子公司）共有员工 787 人，84%的员工拥有硕士以上学历。公司投研团队由资深基金经理和研究员组成，投研人员 215 人，投资人员平均拥有 12 年的从业经验。

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 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，为超 9000 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 2024 年 6 月 30 日，工银瑞信（含子公司）旗下管理 251 只公募基金和多个年金、私募资产管理计划，资产管理总规模约 1.9 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		
刘伟琳	指数及量化投资部投资副总监、本基金的基金经理	2019 年 5 月 20 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，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；2014 年 10 月 17 日至 2024 年 1 月 9 日，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

				<p>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; 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 2023 年 9 月 27 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</p>
--	--	--	--	---

					<p>投资基金发起式联接基金基金经理；2021 年 12 月 14 日至 2023 年 9 月 27 日，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；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；2023 年 8 月 31 日至今，担任工银瑞信中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 11 月 9 日至今，担任工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期末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 3 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

2024 年以来，国内宏观经济处在“经济底部震荡，政策维持呵护”的状态。经济在预期轨道上运行，市场整体呈现震荡格局。风格上，市场呈现“价值优于成长”的局面。一方面，A 股整体企业盈利周期下行，价值板块的盈利相对优势明显；另一方面，成长板块尤其是新能源、医药等权重方向，在过去几年积累了较为集中的筹码结构且估值不低，叠加地缘政治风险，在今年以来明显偏弱的资金面背景下表现不佳。

股市方面，上半年 A 股整体呈现倒 V 字型走势，红利稳定类行业涨幅靠前。回顾上半年 A 股市场表现，主要宽基指数多数收跌，其中上证综指下跌 0.3%，深证成指下跌 7.1%，沪深 300 指数上涨 0.9%。从风格来看，代表大盘股的中证 100 指数和代表中盘股的中证 500 指数回报分别为 1.4% 和 -9.0%，创业板指和科创 50 回报分别为 -11.0% 和 -16.4%。分行业来看，各行业涨跌幅分化较大，银行、煤炭和公用事业表现排名前三位，收益率分别为 17.0%、12.0% 和 11.8%，计算机、商贸零售和社会服务排名后三位，收益率分别为 -24.9%、-24.6% 和 -24.1%。

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 2.03%，业绩比较基准收益率为 0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济内生增长动能依然偏弱，但在政策持续释放积极信号的背景下，我们倾向于认为，更大力度的货币和财政政策能够推动国内经济增长企稳改善。海外方面，虽然当前美国经济和通胀韧性令美联储降息不断后移，我们的基准假设是未来一年美联储降息是大概率事件，这将有助于改善全球金融条件。

我们认为当前影响 A 股市场的核心因素仍是国内经济增长预期。4 月底以来房地产政策态度和落地细则发生了明显调整，给定目前政策力度评估房地产市场和宏观经济的企稳回升仍不足够，

但一是政策的态度表明房价出现急速下跌的尾部风险降低；二是从供给侧向需求侧的思路转变，有利于解决当前房地产市场库存堆积、从刚需到改善循环不畅的问题；三是政策突破此前框架为后续政策出台创造了想象空间，因此我们认为经济增长仍处在下有底、向上弹性的区间，再通胀仍需等待。对应到市场，短期来看，我们认为当前权益市场整体预期较弱，稳定类高股息资产仍可能占优。同时与 GDP 相关的行业配置胜率有所提升但时点仍略偏左侧，可选择产能、资金出清充分的资产进行配置；长期而言，随着科技创新带来的变革，以及 A 股资产估值的收敛，我们认为更大的机会是在不断酝酿的，在未来 3-5 年可以找到更多的投资机会。

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（或委员会）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

（1）职责分工

估值委员会由主任委员、委员组成。

主任委员为公司分管运营副总经理，委员为委员会部门负责人。估值委员会部门包括：投研部门（固定收益部、研究部、指数及量化投资部、FOF 投资部）、风险管理部、法律合规部，运作部。

委员无法出席估值委员会会议的，应指定本部门熟悉情况的人员代为参会，指定人员享有委员同等表决权。

（2）专业胜任能力及相关工作经历

委员会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

投资经理可作为列席人员参会，有发言权，无表决权。

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，并经托管人复核确认。

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，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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

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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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遵规守信、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《中华人民共和国证券投资基金法》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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	38,272,821.62	38,714,990.25
结算备付金		15,276,994.90	6,843,393.42
存出保证金		2,905,284.78	51,948.62
交易性金融资产	6.4.7.2	4,056,906,928.26	2,302,882,901.01
其中：股票投资		4,055,597,109.52	2,300,401,004.82
基金投资		-	-
债券投资		1,309,818.74	2,481,896.19
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	-	-
应收清算款		-	56,338.40
应收股利		107,694.94	28,152.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	77,769.84	140,636.49
资产总计		4,113,547,494.34	2,348,718,360.19
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		21,465,825.05	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		479,108.34	875,865.97
应付托管费		159,702.78	194,636.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		34,406.29	13,700.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,359,934.13	737,587.57
负债合计		23,498,976.59	1,821,791.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,355,170,128.58	2,423,164,961.58
未分配利润	6.4.7.12	-265,121,610.83	-76,268,392.40

净资产合计		4,090,048,517.75	2,346,896,569.18
负债和净资产总计		4,113,547,494.34	2,348,718,360.19

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 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 3.5808 元，基金份额总额为 1,142,214,701.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		93,648,603.10	25,064,694.89
1. 利息收入		2,201,710.05	2,505,817.55
其中：存款利息收入	6.4.7.13	496,491.45	294,634.07
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		-	-
其他利息收入		1,705,218.60	2,211,183.48
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-49,235,448.14	-20,271,398.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-95,857,325.09	-50,790,051.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	78,732.78	293,521.48
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	3,261,588.93	-1,829.75
股利收益	6.4.7.19	43,281,555.24	30,226,961.06
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	138,829,007.38	42,271,929.79
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	1,853,333.81	558,346.19
减：二、营业总支出		4,646,453.56	7,755,917.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,114,847.05	5,888,114.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	914,041.73	1,308,470.02

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		17,894.80	7,973.42
8. 其他费用	6.4.7.23	599,669.98	551,359.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		89,002,149.54	17,308,777.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		89,002,149.54	17,308,777.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		89,002,149.54	17,308,777.47

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,423,164,961.58	-76,268,392.40	2,346,896,569.18
二、本期期初净资产	2,423,164,961.58	-76,268,392.40	2,346,896,569.18
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	1,932,005,167.00	-188,853,218.43	1,743,151,948.57
（一）、综合收益总额	-	89,002,149.54	89,002,149.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	1,932,005,167.00	-61,746,892.68	1,870,258,274.32
其中：1. 基金申购款	2,264,872,842.34	-65,976,395.70	2,198,896,446.64
2. 基金赎回款	-332,867,675.34	4,229,503.02	-328,638,172.32
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变	-	-216,108,475.29	-216,108,475.29

动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	4,355,170,128.58	-265,121,610.83	4,090,048,517.75
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,454,049,591.35	162,353,287.17	2,616,402,878.52
二、本期期初净资产	2,454,049,591.35	162,353,287.17	2,616,402,878.52
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-82,359,012.53	6,508,029.82	-75,850,982.71
（一）、综合收益总额	-	17,308,777.47	17,308,777.47
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-82,359,012.53	-10,800,747.65	-93,159,760.18
其中：1. 基金申购款	267,666,790.47	30,633,494.65	298,300,285.12
2. 基金赎回款	-350,025,803.00	-41,434,242.30	-391,460,045.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,371,690,578.82	168,861,316.99	2,540,551,895.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵桂才	郝炜	关亚君
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据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 号文,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，存续期限为不定期，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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 05 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。

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颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（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》、中国证监会发布的《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〉》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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[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》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(4) 基金在境内卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(6) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	38,272,821.62
等于：本金	38,256,894.69
加：应计利息	15,926.93
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	38,272,821.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,462,646,481.80	-	4,055,597,109.52	-407,049,372.28
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	1,040,000.00	1,914.74	1,309,818.74	267,904.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,040,000.00	1,914.74	1,309,818.74	267,904.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,463,686,481.80	1,914.74	4,056,906,928.26	-406,781,468.28

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	19,819,220.40	-	-	
其中：股指期货投资	19,819,220.40	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	19,819,220.40	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于本报告期末所有的股指期货合约产生的持仓损益金额。因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2409	IF2409	21.00	21,568,680.00	1,749,459.60
合计				1,749,459.60
减：可抵销期货暂收款				1,749,459.60
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
----	-------------------

应收利息	-
其他应收款	77,769.84
待摊费用	-
合计	77,769.84

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	763,272.53
其中：交易所市场	763,272.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	42,267.68
预提信息披露费	59,672.34
应退替代款	220,581.70
指数使用费	259,672.04
IOPV 服务费	14,467.84
合计	1,359,934.13

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	635,514,701.00	2,423,164,961.58
本期申购	594,000,000.00	2,264,872,842.34
本期赎回（以“-”号填列）	-87,300,000.00	-332,867,675.34
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	1,142,214,701.00	4,355,170,128.58

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
上年度末	507,870,617.85	-584,139,010.25	-76,268,392.40
本期期初	507,870,617.85	-584,139,010.25	-76,268,392.40
本期利润	-49,826,857.84	138,829,007.38	89,002,149.54
本期基金份额交易产生的变动数	387,437,616.89	-449,184,509.57	-61,746,892.68
其中：基金申购款	453,754,609.35	-519,731,005.05	-65,976,395.70
基金赎回款	-66,316,992.46	70,546,495.48	4,229,503.02
本期已分配利润	-216,108,475.29	-	-216,108,475.29
本期末	629,372,901.61	-894,494,512.44	-265,121,610.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	392,636.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	102,231.29
其他	1,623.88
合计	496,491.45

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-81,279,711.17
股票投资收益——赎回差价收入	-14,577,613.92
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	-95,857,325.09

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
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	488,324,654.02
减：卖出股票成本总额	568,245,002.63
减：交易费用	1,359,362.56
买卖股票差价收入	-81,279,711.17

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	328,638,172.32
减：现金支付赎回款总额	120,386,376.32
减：赎回股票成本总额	222,829,409.92
减：交易费用	-
赎回差价收入	-14,577,613.92

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,270.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	73,462.07
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	78,732.78

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,336,627.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,261,000.00

减：应计利息总额	2,111.73
减：交易费用	53.43
买卖债券差价收入	73,462.07

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,261,588.93

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	43,281,555.24
其中：证券出借权益补偿收入	770,564.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	43,281,555.24

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	137,079,547.78
股票投资	136,988,147.55
债券投资	91,400.23
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,749,459.60
权证投资	-
期货投资	1,749,459.60
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	138,829,007.38

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,853,333.81
合计	1,853,333.81

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	42,267.68
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	473,880.63
银行费用	9,381.49
IOPV 服务费	14,467.84
合计	599,669.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,114,847.05	5,888,114.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,883.78	28,161.75
应支付基金管理人的净管理费	3,096,963.27	5,859,953.04

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

根据本基金管理人发布的公告，自 2024 年 2 月 8 日起，本基金的管理费年费率由 0.45% 调整为 0.15%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	914,041.73	1,308,470.02

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。

根据本基金管理人发布的公告，自 2024 年 2 月 8 日起，本基金的托管费年费率由 0.10% 调整为 0.05%。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	30,177,500.00	2.64	17,523,400.00	2.76

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	38,272,821.62	392,636.28	57,947,617.01	221,748.15

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 7,287,700.00 股农业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 31,774,372.00 元，占基金资产净值的比例为 0.78%；本基金持有 7,997,800.00 股工商银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 45,587,460.00 元，占基金资产净值的比例为 1.11%。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 4,220,900.00 股农业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 15,364,076.00 元，占基金资产净值的比例为 0.65%；本基金持有 4,622,500.00 股工商银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 22,095,550.00 元，占基金资产净值的比例为 0.94%。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发 放 总 额	本期利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 6 月 19 日	2024 年 6 月 20 日	-	1.901	216,108,475.29	-	216,108,475.29	-
合计	-	-	-	1.901	216,108,475.29	-	216,108,475.29	-

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位 : 股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
----------	------------------	-----------------------	-------------	----------------------------	------------------	----------------------------	----------------------------------	----------------------------	----------------------------	--------

301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定	70.48	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-

603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000002	万科A	2024年7月5日	6.93	314,000	2,176,020.00
2	000157	中联重科	2024年7月5日	7.68	4,500	34,560.00
3	000301	东方盛虹	2024年7月4日-2024年7月5日	7.97	7,000	55,790.00
4	000333	美的集团	2024年7月5日	64.50	2,000	129,000.00
5	000538	云南白药	2024年7月5日	51.15	10,000	511,500.00
6	000596	古井贡酒	2024年7月5日	211.07	3,700	780,959.00
7	000617	中油资本	2024年7月4日	5.52	10,600	58,512.00
8	000625	长安汽车	2024年7月4日-2024年7月5日	13.43	36,400	488,852.00
9	000733	振华科技	2024年7月4日	41.53	10,700	444,371.00
10	000776	广发证券	2024年7月4日	12.17	38,100	463,677.00
11	000800	一汽解放	2024年7月4日-2024年7月5日	7.83	39,300	307,719.00
12	000876	新希望	2024年7月4日	9.14	54,800	500,872.00
13	000938	紫光股份	2024年7月5日	22.35	84,600	1,890,810.00
14	000977	浪潮信	2024年7月1日	36.37	13,100	476,447.00

		息				0
15	000983	山西焦煤	2024 年 7 月 4 日	10.31	72,000	742,320.00
16	001979	招商蛇口	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	8.79	159,700	1,403,763.00
17	002049	紫光国微	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	52.60	10,500	552,300.00
18	002074	国轩高科	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	19.15	49,100	940,265.00
19	002129	TCL 中环	2024 年 7 月 4 日	8.65	1,000	8,650.00
20	002179	中航光电	2024 年 7 月 5 日	38.05	46,500	1,769,325.00
21	002271	东方雨虹	2024 年 7 月 5 日	12.34	20,000	246,800.00
22	002352	顺丰控股	2024 年 7 月 5 日	35.69	30,300	1,081,407.00
23	002410	广联达	2024 年 7 月 4 日	9.58	6,000	57,480.00
24	002460	赣锋锂业	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	28.65	35,100	1,005,615.00
25	002493	荣盛石化	2024 年 7 月 5 日	9.66	14,000	135,240.00
26	002916	深南电路	2024 年 7 月 5 日	105.77	1,000	105,770.00
27	002920	德赛西威	2024 年 7 月 4 日	87.09	4,300	374,487.00
28	002938	鹏鼎控股	2024 年 7 月 4 日	39.76	18,500	735,560.00
29	300142	沃森生物	2024 年 7 月 5 日	11.38	25,000	284,500.00
30	300223	北京君正	2024 年 7 月 4 日	55.44	1,000	55,440.00
31	300308	中际旭创	2024 年 7 月 5 日	137.88	1,400	193,032.00
32	300347	泰格医药	2024 年 7 月 5 日	48.60	1,000	48,600.00
33	300498	温氏股份	2024 年 7 月 5 日	19.82	147,700	2,927,414.00
34	300661	圣邦股份	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	82.78	11,500	951,970.00
35	300957	贝泰妮	2024 年 7 月 5 日	48.32	5,300	256,096.00
36	600009	上海机场	2024 年 7 月 5 日	32.25	1,000	32,250.00

37	600011	华能国际	2024 年 7 月 5 日	9.62	1,800	17,316.00
38	600061	国投资本	2024 年 7 月 4 日	5.65	8,000	45,200.00
39	600104	上汽集团	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	13.86	218,200	3,024,252.00
40	600111	北方稀土	2024 年 7 月 9 日	17.20	2,500	43,000.00
41	600115	中国东航	2024 年 7 月 4 日	4.01	131,900	528,919.00
42	600176	中国巨石	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	11.05	51,300	566,865.00
43	600188	兖矿能源	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	22.73	65,700	1,493,361.00
44	600346	恒力石化	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	13.95	43,600	608,220.00
45	600362	江西铜业	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	23.68	31,200	738,816.00
46	600372	中航机载	2024 年 7 月 4 日	11.97	2,000	23,940.00
47	600438	通威股份	2024 年 7 月 5 日	19.11	24,600	470,106.00
48	600460	士兰微	2024 年 7 月 4 日	17.51	17,300	302,923.00
49	600547	山东黄金	2024 年 7 月 5 日	27.38	35,600	974,728.00
50	600570	恒生电子	2024 年 7 月 4 日	17.66	24,100	425,606.00
51	600732	爱旭股份	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	9.05	49,800	450,690.00
52	600741	华域汽车	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	16.38	2,000	32,760.00
53	600809	山西汾酒	2024 年 7 月 5 日	210.88	7,400	1,560,512.00
54	600893	航发动力	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	36.55	64,000	2,339,200.00
55	600989	宝丰能源	2024 年 7 月 5 日	17.33	6,900	119,577.00
56	601006	大秦铁路	2024 年 7 月 4 日	7.16	71,500	511,940.00
57	601012	隆基绿能	2024 年 7 月 5 日	14.02	271,600	3,807,832.00
58	601021	春秋航空	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	56.33	11,400	642,162.00

59	601059	信达证 券	2024 年 7 月 4 日	14.21	16,700	237,307.0 0
60	601088	中国神 华	2024 年 7 月 5 日	44.37	27,400	1,215,738 .00
61	601111	中国国 航	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	7.38	217,300	1,603,674 .00
62	601169	北京银 行	2024 年 7 月 5 日	5.84	14,600	85,264.00
63	601225	陕西煤 业	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	25.77	30,000	773,100.0 0
64	601238	广汽集 团	2024 年 7 月 5 日	7.74	12,200	94,428.00
65	601319	中国人 保	2024 年 7 月 5 日	5.15	92,800	477,920.0 0
66	601360	三六零	2024 年 7 月 4 日	7.68	102,600	787,968.0 0
67	601633	长城汽 车	2024 年 7 月 4 日	25.30	31,300	791,890.0 0
68	601800	中国交 建	2024 年 7 月 5 日	8.94	13,600	121,584.0 0
69	601865	福莱特	2024 年 7 月 5 日	20.10	7,500	150,750.0 0
70	601878	浙商证 券	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	10.72	91,500	980,880.0 0
71	601901	方正证 券	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	7.73	65,500	506,315.0 0
72	601998	中信银 行	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	6.70	263,300	1,764,110 .00
73	603195	公牛集 团	2024 年 7 月 4 日	77.12	4,060	313,107.2 0
74	603259	药明康 德	2024 年 7 月 5 日	39.19	1,000	39,190.00
75	603260	合盛硅 业	2024 年 7 月 4 日	46.71	9,600	448,416.0 0
76	603392	万泰生 物	2024 年 7 月 4 日	65.88	1,700	111,996.0 0
77	603659	璞泰来	2024 年 7 月 9 日	14.13	34,500	487,485.0 0
78	603833	欧派家 居	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	53.56	7,200	385,632.0 0
79	603899	晨光股 份	2024 年 7 月 5 日	31.28	1,500	46,920.00
80	603986	兆易创 新	2024 年 7 月 4 日	95.62	2,000	191,240.0 0

81	605117	德业股份	2024 年 7 月 5 日	74.34	1,680	124,891.20
82	688036	传音控股	2024 年 7 月 5 日	76.54	22,540	1,725,211.60
83	688256	寒武纪	2024 年 7 月 5 日	198.67	5,000	993,350.00
84	688363	华熙生物	2024 年 7 月 2 日	56.57	6,200	350,734.00
85	688396	华润微	2024 年 7 月 5 日	37.44	22,900	857,376.00
86	688599	天合光能	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	16.92	50,400	852,768.00
合计	-	-	-	-	3,589,680	57,474,543.00

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设的风险管理委员会、督察长、公司风险管理与内部控制委员会、法律合规部、风险管理部、稽核审计部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时，对于每一战略环节、业务环节，公司都制定了系统化的风险管理程序，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由三大防线共同筑成的风险管理体系。其中：

(1) 各业务部门是风险管理的第一道防线，将管控好风险作为开展业务的前提和保障，落实各项风险管理措施，承担风险管理的第一责任。第一道防线按照法律法规的规定，制定本业务条线的制度和流程，对经营和业务流程中的风险主动识别、评估和控制，收集和报告风险点，针对薄弱环节及时进行完善。通过对业务和产品相关制度、流程、系统的自我评估、自我检查、自我完善、自我培训，履行业务经营过程中的自我风险控制职能。

(2) 风险管理部、法律合规部和各风险职能部门是风险管理的第二道防线。第二道防线通过制定风险管理政策、标准和要求，为第一道防线提供风险管理的方法、工具、流程、培训和指导，主动为第一道防线风险管控提供支持，独立监控、评估、报告公司整体及业务条线的风险状况和

风险变化情况。监督和检查第一道防线风险管理措施的执行和有效性，为第三道防线开展再检查、再监督和内部控制评价提供基础。法律合规部负责合规风险的宣导培训、合规咨询、审查审核和监督检查，负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查，风险管理部负责对公司的投资风险进行独立评估、监控、检查和报告。

(3) 稽核审计部是风险管理的第三道防线。通过内部独立、客观的监督与评价，采用系统化、规范化方法，对第一道、第二道防线在风险管理中的履职情况进行审计，对风险管理的效果进行独立客观的监督、审计、评价和报告，促进公司发展战略和经营管理目标的实现。

同时，公司董事会确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对重大事件、重大决策的风险评估意见和风险管理报告进行审议，审批重大风险的解决方案；公司管理层根据董事会的风险管理战略，制定并确保公司风险管理制度得以全面、有效执行，在董事会授权范围内批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案，组织各业务部门开展风险管控工作。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人通过信用评级团队和中央交易室建立了内部评级体系和交易对手库，对债券发行主体及债券进行内部评级并跟踪进行评级调整，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	1,309,818.74	1,383,472.53
AAA 以下	-	1,098,423.66
未评级	-	-
合计	1,309,818.74	2,481,896.19

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	38,272,821.62	-	-	-	38,272,821.62
结算备付金	15,276,994.90	-	-	-	15,276,994.90
存出保证金	2,905,284.78	-	-	-	2,905,284.78
交易性金融资产	-	1,309,818.74	-4,055,597,109.52	-	4,056,906,928.26
应收股利	-	-	-	107,694.94	107,694.94
其他资产	-	-	-	77,769.84	77,769.84
资产总计	56,455,101.30	1,309,818.74	-4,055,782,574.30	-	4,113,547,494.34
负债					
应付清算款	-	-	-	21,465,825.05	21,465,825.05
应付管理人报酬	-	-	-	479,108.34	479,108.34
应付托管费	-	-	-	159,702.78	159,702.78
应交税费	-	-	-	34,406.29	34,406.29
其他负债	-	-	-	1,359,934.13	1,359,934.13
负债总计	-	-	-	23,498,976.59	23,498,976.59
利率敏感度缺口	56,455,101.30	1,309,818.74	-4,032,283,597.71	-	4,090,048,517.75
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	38,714,990.25	-	-	-	38,714,990.25
结算备付金	6,843,393.42	-	-	-	6,843,393.42

存出保证金	51,948.62	-	-	-	51,948.62
交易性金融资产	-	1,928,505.44	553,390.75	2,300,401,004.82	2,302,882,901.01
应收清算款	-	-	-	56,338.40	56,338.40
应收股利	-	-	-	28,152.00	28,152.00
其他资产	-	-	-	140,636.49	140,636.49
资产总计	45,610,332.29	1,928,505.44	553,390.75	2,300,626,131.71	2,348,718,360.19
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	875,865.97	875,865.97
应付托管费	-	-	-	194,636.85	194,636.85
应交税费	-	-	-	13,700.62	13,700.62
其他负债	-	-	-	737,587.57	737,587.57
负债总计	-	-	-	1,821,791.01	1,821,791.01
利率敏感度缺口	45,610,332.29	1,928,505.44	553,390.75	2,298,804,340.70	2,346,896,569.18

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
分析	利率减少 25 基准点	12,394.19	27,934.23
	利率增加 25 基准点	-12,245.46	-27,548.29

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	4,055,597,109.52	99.16	2,300,401,004.82	98.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,309,818.74	0.03	2,481,896.19	0.11
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	4,056,906,928.26	99.19	2,302,882,901.01	98.12

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。		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	201,848,696.54	116,138,470.34
	业绩比较基准减少 5%	-201,848,696.54	-116,138,470.34

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	4,056,372,143.80	2,299,155,384.86
第二层次	45,611.11	-
第三层次	489,173.35	3,727,516.15
合计	4,056,906,928.26	2,302,882,901.01

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、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,055,597,109.52	98.59
	其中：股票	4,055,597,109.52	98.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,309,818.74	0.03
	其中：债券	1,309,818.74	0.03
	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	53,549,816.52	1.30
8	其他各项资产	3,090,749.56	0.08
9	合计	4,113,547,494.34	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。

3、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 57,474,543.00 元，占期末资产净值比例为 1.41%。

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	51,278,015.92	1.25
B	采矿业	246,912,221.51	6.04
C	制造业	2,110,943,790.26	51.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	190,285,923.08	4.65
E	建筑业	90,730,678.38	2.22
F	批发和零售业	10,404,816.00	0.25

G	交通运输、仓储和邮政业	151,910,238.93	3.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,024,342.25	4.47
J	金融业	906,568,376.16	22.17
K	房地产业	37,325,387.22	0.91
L	租赁和商务服务业	32,548,807.76	0.80
M	科学研究和技术服务业	32,140,303.78	0.79
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	10,983,369.60	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,055,056,270.85	99.14

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	473,779.97	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	540,838.67	0.01

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	600519	贵州茅台	143,360	210,365,030.40	5.14
2	300750	宁德时代	602,520	108,471,675.60	2.65
3	601318	中国平安	2,456,904	101,617,549.44	2.48
4	600036	招商银行	2,825,141	96,591,570.79	2.36
5	600900	长江电力	2,791,913	80,742,123.96	1.97
6	000333	美的集团	1,114,683	71,897,053.50	1.76
7	601899	紫金矿业	3,759,277	66,050,496.89	1.61
8	601166	兴业银行	3,318,750	58,476,375.00	1.43
9	000858	五粮液	443,028	56,725,305.12	1.39
10	002594	比亚迪	206,727	51,733,431.75	1.26
11	601328	交通银行	6,274,000	46,866,780.00	1.15
12	601398	工商银行	7,997,800	45,587,460.00	1.11
13	002475	立讯精密	1,147,398	45,104,215.38	1.10
14	600030	中信证券	2,227,246	40,602,694.58	0.99
15	000651	格力电器	1,028,797	40,349,418.34	0.99
16	300760	迈瑞医疗	138,300	40,232,853.00	0.98
17	600276	恒瑞医药	1,019,583	39,213,162.18	0.96
18	600887	伊利股份	1,453,818	37,566,657.12	0.92
19	600309	万华化学	429,921	34,763,412.06	0.85
20	000725	京东方 A	8,433,000	34,490,970.00	0.84
21	601088	中国神华	752,500	33,388,425.00	0.82
22	601288	农业银行	7,287,700	31,774,372.00	0.78
23	300059	东方财富	2,883,175	30,446,328.00	0.74

24	601816	京沪高铁	5,602,400	30,084,888.00	0.74
25	300308	中际旭创	204,820	28,240,581.60	0.69
26	002714	牧原股份	624,007	27,206,705.20	0.67
27	601857	中国石油	2,585,869	26,686,168.08	0.65
28	002415	海康威视	851,485	26,319,401.35	0.64
29	601668	中国建筑	4,749,700	25,220,907.00	0.62
30	600919	江苏银行	3,348,631	24,880,328.33	0.61
31	601138	工业富联	907,499	24,865,472.60	0.61
32	600690	海尔智家	863,797	24,514,558.86	0.60
33	000568	泸州老窖	167,953	24,099,575.97	0.59
34	300498	温氏股份	1,214,496	24,071,310.72	0.59
35	600809	山西汾酒	111,298	23,470,522.24	0.57
36	002371	北方华创	72,631	23,233,930.59	0.57
37	601985	中国核电	2,154,600	22,968,036.00	0.56
38	600406	国电南瑞	916,405	22,873,468.80	0.56
39	601225	陕西煤业	885,900	22,829,643.00	0.56
40	603259	药明康德	576,502	22,593,113.38	0.55
41	601919	中远海控	1,455,690	22,548,638.10	0.55
42	000001	平安银行	2,214,200	22,474,130.00	0.55
43	600031	三一重工	1,357,072	22,391,688.00	0.55
44	601988	中国银行	4,812,900	22,235,598.00	0.54
45	600941	中国移动	206,000	22,145,000.00	0.54
46	600000	浦发银行	2,679,467	22,052,013.41	0.54
47	300124	汇川技术	427,782	21,945,216.60	0.54
48	601601	中国太保	781,944	21,784,959.84	0.53
49	601728	中国电信	3,541,300	21,778,995.00	0.53
50	000792	盐湖股份	1,241,200	21,658,940.00	0.53
51	600028	中国石化	3,332,800	21,063,296.00	0.51
52	601766	中国中车	2,774,956	20,839,919.56	0.51
53	600150	中国船舶	510,700	20,790,597.00	0.51
54	688981	中芯国际	450,955	20,789,025.50	0.51
55	300274	阳光电源	331,620	20,570,388.60	0.50
56	600050	中国联通	4,358,400	20,484,480.00	0.50
57	000063	中兴通讯	727,749	20,355,139.53	0.50
58	000338	潍柴动力	1,238,393	20,111,502.32	0.49
59	002352	顺丰控股	558,793	19,943,322.17	0.49
60	601169	北京银行	3,378,300	19,729,272.00	0.48
61	601012	隆基绿能	1,383,085	19,390,851.70	0.47
62	603501	韦尔股份	194,230	19,300,635.10	0.47
63	600837	海通证券	2,206,191	18,884,994.96	0.46
64	000100	TCL 科技	4,288,660	18,527,011.20	0.45
65	600016	民生银行	4,858,300	18,412,957.00	0.45
66	002230	科大讯飞	422,429	18,143,325.55	0.44

67	600660	福耀玻璃	365,394	17,502,372.60	0.43
68	002142	宁波银行	752,994	16,611,047.64	0.41
69	601229	上海银行	2,270,463	16,483,561.38	0.40
70	600089	特变电工	1,154,270	16,009,724.90	0.39
71	600938	中国海油	477,500	15,757,500.00	0.39
72	601390	中国中铁	2,341,800	15,268,536.00	0.37
73	000625	长安汽车	1,133,770	15,226,531.10	0.37
74	688041	海光信息	212,199	14,921,833.68	0.36
75	600104	上汽集团	1,057,945	14,663,117.70	0.36
76	603986	兆易创新	152,252	14,558,336.24	0.36
77	601688	华泰证券	1,168,098	14,472,734.22	0.35
78	600048	保利发展	1,640,000	14,366,400.00	0.35
79	601006	大秦铁路	2,003,600	14,345,776.00	0.35
80	600436	片仔癀	69,000	14,294,730.00	0.35
81	600905	三峡能源	3,267,100	14,244,556.00	0.35
82	688012	中微公司	99,069	13,994,486.94	0.34
83	002027	分众传媒	2,306,500	13,977,390.00	0.34
84	601211	国泰君安	1,029,615	13,951,283.25	0.34
85	601888	中国中免	222,824	13,924,271.76	0.34
86	603019	中科曙光	334,520	13,882,580.00	0.34
87	601600	中国铝业	1,808,936	13,802,181.68	0.34
88	603993	洛阳钼业	1,613,600	13,715,600.00	0.34
89	600019	宝钢股份	2,020,661	13,437,395.65	0.33
90	601818	光大银行	4,232,700	13,417,659.00	0.33
91	603288	海天味业	381,205	13,140,136.35	0.32
92	600585	海螺水泥	547,601	12,917,907.59	0.32
93	601658	邮储银行	2,535,900	12,857,013.00	0.31
94	601989	中国重工	2,605,500	12,845,115.00	0.31
95	600886	国投电力	681,461	12,429,848.64	0.30
96	601009	南京银行	1,179,000	12,249,810.00	0.30
97	600795	国电电力	2,038,000	12,207,620.00	0.30
98	688111	金山办公	52,633	11,974,007.50	0.29
99	688008	澜起科技	208,414	11,912,944.24	0.29
100	601628	中国人寿	380,509	11,814,804.45	0.29
101	600438	通威股份	617,093	11,792,647.23	0.29
102	600999	招商证券	847,510	11,788,864.10	0.29
103	000938	紫光股份	521,376	11,652,753.60	0.28
104	000425	徐工机械	1,618,900	11,575,135.00	0.28
105	601939	建设银行	1,534,600	11,356,040.00	0.28
106	600547	山东黄金	411,933	11,278,725.54	0.28
107	300014	亿纬锂能	280,215	11,186,182.80	0.27
108	600893	航发动力	304,480	11,128,744.00	0.27
109	002304	洋河股份	137,495	11,101,346.30	0.27

110	002179	中航光电	290,176	11,041,196.80	0.27
111	601669	中国电建	1,969,262	11,008,174.58	0.27
112	300015	爱尔眼科	1,064,280	10,983,369.60	0.27
113	000002	万科 A	1,553,001	10,762,296.93	0.26
114	002241	歌尔股份	546,900	10,670,019.00	0.26
115	600926	杭州银行	810,753	10,580,326.65	0.26
116	000538	云南白药	203,720	10,420,278.00	0.25
117	600584	长电科技	326,600	10,356,486.00	0.25
118	600760	中航沈飞	252,092	10,108,889.20	0.25
119	600111	北方稀土	578,700	9,953,640.00	0.24
120	600489	中金黄金	662,700	9,807,960.00	0.24
121	002050	三花智控	510,349	9,737,458.92	0.24
122	600011	华能国际	1,005,956	9,677,296.72	0.24
123	601916	浙商银行	3,449,200	9,519,792.00	0.23
124	002252	上海莱士	1,213,500	9,489,570.00	0.23
125	688256	寒武纪	47,578	9,452,321.26	0.23
126	600015	华夏银行	1,451,131	9,287,238.40	0.23
127	600009	上海机场	284,126	9,163,063.50	0.22
128	600958	东方证券	1,191,428	9,054,852.80	0.22
129	600426	华鲁恒升	338,900	9,028,296.00	0.22
130	601186	中国铁建	1,050,900	9,006,213.00	0.22
131	002311	海大集团	190,300	8,953,615.00	0.22
132	300408	三环集团	306,608	8,949,887.52	0.22
133	000166	申万宏源	2,057,400	8,867,394.00	0.22
134	000157	中联重科	1,136,323	8,726,960.64	0.21
135	601901	方正证券	1,127,717	8,717,252.41	0.21
136	600989	宝丰能源	502,200	8,703,126.00	0.21
137	000977	浪潮信息	235,100	8,550,587.00	0.21
138	600674	川投能源	445,000	8,343,750.00	0.20
139	003816	中国广核	1,794,100	8,306,683.00	0.20
140	300433	蓝思科技	455,099	8,305,556.75	0.20
141	688271	联影医疗	75,319	8,262,494.30	0.20
142	000776	广发证券	676,800	8,236,656.00	0.20
143	002049	紫光国微	154,820	8,143,532.00	0.20
144	002001	新和成	423,923	8,139,321.60	0.20
145	601377	兴业证券	1,578,676	7,988,100.56	0.20
146	688036	传音控股	103,212	7,899,846.48	0.19
147	000596	古井贡酒	37,328	7,878,820.96	0.19
148	601111	中国国航	1,064,100	7,853,058.00	0.19
149	600115	中国东航	1,949,662	7,818,144.62	0.19
150	300122	智飞生物	272,717	7,644,257.51	0.19
151	000768	中航西飞	316,971	7,616,813.13	0.19
152	002460	赣锋锂业	258,480	7,405,452.00	0.18

153	601800	中国交建	813,800	7,275,372.00	0.18
154	600029	南方航空	1,233,890	7,267,612.10	0.18
155	001979	招商蛇口	826,651	7,266,262.29	0.18
156	600010	包钢股份	5,175,300	7,245,420.00	0.18
157	601633	长城汽车	284,604	7,200,481.20	0.18
158	600188	兖矿能源	314,700	7,153,131.00	0.17
159	002466	天齐锂业	236,700	7,079,697.00	0.17
160	002601	龙佰集团	380,600	7,067,742.00	0.17
161	002236	大华股份	452,300	6,992,558.00	0.17
162	002648	卫星化学	385,120	6,924,457.60	0.17
163	601117	中国化学	838,600	6,910,064.00	0.17
164	000786	北新建材	231,000	6,851,460.00	0.17
165	603799	华友钴业	309,117	6,840,759.21	0.17
166	000661	长春高新	73,854	6,777,581.58	0.17
167	600346	恒力石化	481,580	6,718,041.00	0.16
168	002493	荣盛石化	694,255	6,706,503.30	0.16
169	000983	山西焦煤	649,100	6,692,221.00	0.16
170	300782	卓胜微	85,340	6,634,331.60	0.16
171	601838	成都银行	436,198	6,625,847.62	0.16
172	600161	天坛生物	271,200	6,617,280.00	0.16
173	603369	今世缘	143,100	6,611,220.00	0.16
174	600372	中航机载	550,700	6,591,879.00	0.16
175	600023	浙能电力	919,000	6,534,090.00	0.16
176	601788	光大证券	446,742	6,531,368.04	0.16
177	688223	晶科能源	912,553	6,479,126.30	0.16
178	600196	复星医药	290,092	6,422,636.88	0.16
179	000807	云铝股份	474,800	6,414,548.00	0.16
180	601998	中信银行	952,700	6,383,090.00	0.16
181	002129	TCL 中环	736,525	6,370,941.25	0.16
182	300418	昆仑万维	196,300	6,328,712.00	0.15
183	002938	鹏鼎控股	158,300	6,294,008.00	0.15
184	600845	宝信软件	196,989	6,289,858.77	0.15
185	601872	招商轮船	743,800	6,285,110.00	0.15
186	601021	春秋航空	111,568	6,284,625.44	0.15
187	601868	中国能建	2,958,600	6,272,232.00	0.15
188	601360	三六零	814,500	6,255,360.00	0.15
189	300661	圣邦股份	75,405	6,242,025.90	0.15
190	600233	圆通速递	392,400	6,141,060.00	0.15
191	600219	南山铝业	1,601,300	6,100,953.00	0.15
192	600570	恒生电子	345,097	6,094,413.02	0.15
193	600176	中国巨石	548,266	6,058,339.30	0.15
194	600085	同仁堂	156,100	5,964,581.00	0.15
195	002180	纳思达	225,600	5,960,352.00	0.15

196	601995	中金公司	200,500	5,936,805.00	0.15
197	605499	东鹏饮料	27,500	5,933,125.00	0.15
198	300896	爱美客	34,440	5,927,124.00	0.14
199	600600	青岛啤酒	80,800	5,879,816.00	0.14
200	600741	华域汽车	358,640	5,874,523.20	0.14
201	300347	泰格医药	118,500	5,759,100.00	0.14
202	603392	万泰生物	87,011	5,732,284.68	0.14
203	002736	国信证券	657,600	5,714,544.00	0.14
204	601066	中信建投	296,801	5,710,451.24	0.14
205	601336	新华保险	189,840	5,700,895.20	0.14
206	601100	恒立液压	122,356	5,699,342.48	0.14
207	600183	生益科技	270,466	5,696,013.96	0.14
208	601689	拓普集团	106,200	5,693,382.00	0.14
209	002271	东方雨虹	458,760	5,661,098.40	0.14
210	000895	双汇发展	236,600	5,623,982.00	0.14
211	600745	闻泰科技	198,300	5,601,975.00	0.14
212	600362	江西铜业	236,300	5,595,584.00	0.14
213	000963	华东医药	199,600	5,550,876.00	0.14
214	001965	招商公路	466,700	5,535,062.00	0.14
215	002920	德赛西威	63,500	5,530,215.00	0.14
216	600027	华电国际	775,300	5,380,582.00	0.13
217	601881	中国银河	495,200	5,377,872.00	0.13
218	601898	中煤能源	418,000	5,216,640.00	0.13
219	688126	沪硅产业	377,592	5,214,545.52	0.13
220	300033	同花顺	49,120	5,093,744.00	0.12
221	002459	晶澳科技	451,880	5,061,056.00	0.12
222	601618	中国中冶	1,629,800	5,052,380.00	0.12
223	000999	华润三九	117,030	4,983,137.40	0.12
224	002916	深南电路	46,938	4,964,632.26	0.12
225	601699	潞安环能	272,700	4,944,051.00	0.12
226	600026	中远海能	316,100	4,934,321.00	0.12
227	600515	海南机场	1,570,200	4,930,428.00	0.12
228	601607	上海医药	254,000	4,853,940.00	0.12
229	300832	新产业	71,500	4,821,960.00	0.12
230	000301	东方盛虹	605,000	4,821,850.00	0.12
231	601878	浙商证券	442,350	4,741,992.00	0.12
232	000876	新希望	518,505	4,739,135.70	0.12
233	600039	四川路桥	597,820	4,716,799.80	0.12
234	600332	白云山	160,400	4,704,532.00	0.12
235	600875	东方电气	254,400	4,693,680.00	0.11
236	002074	国轩高科	244,600	4,684,090.00	0.11
237	600588	用友网络	467,361	4,673,610.00	0.11
238	601877	正泰电器	244,715	4,664,267.90	0.11

239	600415	小商品城	626,300	4,647,146.00	0.11
240	002555	三七互娱	355,617	4,640,801.85	0.11
241	002709	天赐材料	262,300	4,605,988.00	0.11
242	688396	华润微	120,532	4,512,718.08	0.11
243	600025	华能水电	412,092	4,442,351.76	0.11
244	600803	新奥股份	213,200	4,434,560.00	0.11
245	000408	藏格矿业	179,800	4,327,786.00	0.11
246	300316	晶盛机电	149,100	4,283,643.00	0.10
247	300223	北京君正	76,900	4,263,336.00	0.10
248	002812	恩捷股份	134,500	4,256,925.00	0.10
249	300628	亿联网络	115,380	4,242,522.60	0.10
250	688599	天合光能	248,922	4,211,760.24	0.10
251	300450	先导智能	250,800	4,170,804.00	0.10
252	300142	沃森生物	365,750	4,162,235.00	0.10
253	605117	德业股份	55,064	4,093,457.76	0.10
254	600460	士兰微	227,000	3,974,770.00	0.10
255	002007	华兰生物	249,420	3,938,341.80	0.10
256	601238	广汽集团	507,120	3,925,108.80	0.10
257	300496	中科创达	84,500	3,852,355.00	0.09
258	301269	华大九天	49,300	3,798,565.00	0.09
259	300751	迈为股份	31,740	3,792,295.20	0.09
260	300759	康龙化成	203,880	3,788,090.40	0.09
261	603260	合盛硅业	80,700	3,769,497.00	0.09
262	601319	中国人保	727,600	3,747,140.00	0.09
263	300999	金龙鱼	136,800	3,741,480.00	0.09
264	600018	上港集团	641,100	3,705,558.00	0.09
265	000733	振华科技	88,300	3,667,099.00	0.09
266	601799	星宇股份	32,600	3,652,504.00	0.09
267	600918	中泰证券	637,400	3,614,058.00	0.09
268	002821	凯莱英	54,620	3,593,996.00	0.09
269	300413	芒果超媒	171,230	3,578,707.00	0.09
270	688009	中国通号	593,328	3,559,968.00	0.09
271	603806	福斯特	239,530	3,521,091.00	0.09
272	601865	福莱特	174,000	3,497,400.00	0.09
273	603659	璞泰来	244,515	3,454,996.95	0.08
274	603195	公牛集团	44,307	3,416,955.84	0.08
275	600132	重庆啤酒	55,121	3,345,844.70	0.08
276	600061	国投资本	586,437	3,313,369.05	0.08
277	300919	中伟股份	106,540	3,301,674.60	0.08
278	000617	中油资本	575,300	3,175,656.00	0.08
279	601059	信达证券	221,700	3,150,357.00	0.08
280	000708	中信特钢	231,400	3,140,098.00	0.08
281	688303	大全能源	146,621	2,989,602.19	0.07

282	688187	时代电气	59,074	2,917,074.12	0.07
283	002603	以岭药业	189,500	2,905,035.00	0.07
284	002410	广联达	303,175	2,904,416.50	0.07
285	300454	深信服	57,200	2,890,316.00	0.07
286	002841	视源股份	95,481	2,819,553.93	0.07
287	300442	润泽科技	117,500	2,814,125.00	0.07
288	603899	晨光股份	83,906	2,624,579.68	0.06
289	688363	华熙生物	44,297	2,505,881.29	0.06
290	601808	中海油服	135,370	2,328,364.00	0.06
291	600732	爱旭股份	251,260	2,273,903.00	0.06
292	603833	欧派家居	41,660	2,231,309.60	0.05
293	300979	华利集团	34,400	2,093,240.00	0.05
294	601236	红塔证券	323,890	2,079,373.80	0.05
295	601698	中国卫通	145,600	2,051,504.00	0.05
296	300957	贝泰妮	38,400	1,855,488.00	0.05
297	688082	盛美上海	20,108	1,699,327.08	0.04
298	000800	一汽解放	209,200	1,638,036.00	0.04
299	603296	华勤技术	20,600	1,137,738.00	0.03
300	001289	龙源电力	33,300	574,425.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
5	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
6	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
7	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
8	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
9	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
10	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
11	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
12	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
13	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
16	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
17	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
18	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
19	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00

21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
31	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
32	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	300750	宁德时代	61,677,250.44	2.63
2	000333	美的集团	40,204,335.12	1.71
3	000858	五粮液	37,289,290.64	1.59
4	002594	比亚迪	29,387,702.74	1.25
5	000651	格力电器	23,919,764.62	1.02
6	300760	迈瑞医疗	21,943,450.00	0.93
7	002371	北方华创	21,447,579.00	0.91
8	002475	立讯精密	21,341,339.60	0.91
9	300059	东方财富	20,966,316.95	0.89
10	000725	京东方 A	19,675,550.00	0.84
11	002415	海康威视	15,841,606.00	0.68
12	300124	汇川技术	15,643,706.35	0.67
13	600900	长江电力	14,912,650.00	0.64
14	300274	阳光电源	14,877,927.03	0.63
15	002714	牧原股份	14,748,203.22	0.63
16	600519	贵州茅台	14,441,637.00	0.62
17	000568	泸州老窖	14,123,998.40	0.60
18	300308	中际旭创	13,977,529.60	0.60
19	300498	温氏股份	13,964,005.18	0.59
20	000001	平安银行	13,197,082.00	0.56

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	300750	宁德时代	17,567,895.88	0.75
2	000858	五粮液	12,495,174.01	0.53
3	002594	比亚迪	11,784,828.50	0.50
4	002371	北方华创	11,366,854.00	0.48
5	000333	美的集团	11,003,255.00	0.47
6	300124	汇川技术	7,504,695.00	0.32
7	000651	格力电器	7,423,378.00	0.32
8	600028	中国石化	6,910,759.00	0.29
9	600919	江苏银行	6,892,031.00	0.29
10	002475	立讯精密	6,801,873.60	0.29
11	002142	宁波银行	6,527,325.00	0.28
12	600519	贵州茅台	6,441,178.00	0.27
13	600436	片仔癀	6,223,859.64	0.27
14	601318	中国平安	6,031,972.06	0.26
15	000725	京东方 A	6,014,473.00	0.26
16	300059	东方财富	5,979,159.00	0.25
17	300274	阳光电源	5,889,742.20	0.25
18	600036	招商银行	5,487,114.00	0.23
19	300760	迈瑞医疗	5,078,155.81	0.22
20	002202	金风科技	4,756,364.32	0.20

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	1,019,726,486.12
卖出股票收入（成交）总额	488,324,654.02

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）	1,309,818.74	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,309,818.74	0.03

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	113055	成银转债	10,400	1,309,818.74	0.03

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

本基金投资股指期货，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，从而更好地跟踪标的指数，总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受

到地方外管局、国家金融监管局派出机构、国家金融监管总局的处罚。

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	2,905,284.78
2	应收清算款	-
3	应收股利	107,694.94
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	77,769.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,090,749.56

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	113055	成银转债	1,309,818.74	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	129,000.00	0.00	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.01	新股锁定

2	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定
3	603285	键邦股份	21,596.70	0.00	新股未上市
3	603285	键邦股份	2,405.85	0.00	新股锁定
4	603350	安乃达	19,429.20	0.00	新股未上市
4	603350	安乃达	2,179.36	0.00	新股锁定
5	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
2,767	412,798.95	1,125,598,815.00	98.55	16,615,886.00	1.45

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接基金	30,177,500.00	2.64

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	584,129,672.00	51.14
2	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-一个险分红	170,857,400.00	14.96
3	招商局仁和人寿保险股份有限公司-传统产品 3 号	86,630,800.00	7.58
4	中国人寿保险股份有限公司	77,366,500.00	6.77
5	中国平安人寿保险股	62,017,100.00	5.43

	份有限公司—自有资金		
6	友邦人寿保险有限公司—分红	26,102,900.00	2.29
7	友邦人寿保险有限公司—传统	26,102,700.00	2.29
8	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	26,034,900.00	2.28
9	招商局仁和人寿保险股份有限公司—分红产品 1 号	13,014,100.00	1.14
10	中荷人寿保险有限公司—传统险	4,500,000.00	0.39
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金	30,177,500.00	2.64

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	635,514,701.00
本报告期基金总申购份额	594,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	87,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,142,214,701.00

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

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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

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	875,950,733.38	58.16	557,018.55	54.68	-
西南证券	2	296,492,955.81	19.69	218,183.21	21.42	-
国投证券	2	273,180,093.48	18.14	201,036.60	19.74	-

天风证券	2	38,376,308.58	2.55	28,241.10	2.77	-
瑞银证券	1	20,333,587.18	1.35	12,930.37	1.27	-
中金公司	2	1,420,938.95	0.09	1,045.61	0.10	-
银河证券	1	258,231.67	0.02	166.76	0.02	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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、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) 财务状况良好。
- b) 经营行为规范。
- c) 合规记录优良。

(2) 选择程序

根据以上标准,基金管理人将对证券公司进行考察、选择和确定。根据对其评估结果,决定是否作为新增合作证券公司。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 在合同存续期间,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、综合服务质量高的证券公司租用其交易单元。

(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	-	-	-	-	-	-
西南证券	316,028.66	23.64	-	-	-	-
国投证券	1,020,598.57	76.36	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 1 月 23 日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于终止北京中期时代销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证监会规定的媒介	2024 年 2 月 29 日
3	工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第一次分红公告	中国证监会规定的媒介	2024 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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20%的时间区间					(%)
机构	1	20240101-20240630	584,129,672.00	-	-	584,129,672.00	51.14
	2	20240314-20240508	-	170,857,400.00	-	170,857,400.00	14.96
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

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金自 2024 年 2 月 8 日起调低管理费率、托管费率,并修订《基金合同》、《托管协议》,详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

§ 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

2024 年 8 月 30 日