

工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证 券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国证 2000ETF 基金
场内简称	国证 2000ETF 基金
基金主代码	159543
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 9 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	42,196,551.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 20 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	本基金的股票投资主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	国证 2000 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，主要采用最优化抽样复制策略，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	郝炜	任航
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbcubs.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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	北京市西城区复兴门内大街 28

	厦 A 座 6-9 层	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.icbcubs.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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,625,676.58
本期利润	5,948,889.22
加权平均基金份额本期利润	0.1242
本期加权平均净值利润率	12.35%
本期基金份额净值增长率	12.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,442,953.68
期末可供分配基金份额利润	0.0816
期末基金资产净值	45,639,504.68
期末基金份额净值	1.0816
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.16%

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.29%	1.14%	6.01%	1.05%	1.28%	0.09%
过去三个月	5.88%	1.98%	4.41%	2.00%	1.47%	-0.02%
过去六个月	12.30%	1.80%	10.71%	1.80%	1.59%	0.00%
过去一年	37.08%	2.04%	36.81%	2.08%	0.27%	-0.04%
自基金合同生效起至今	8.16%	1.95%	6.40%	2.02%	1.76%	-0.07%

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



注：1、本基金基金合同于 2023 年 11 月 9 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 798 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 221 人，投资人员平均拥有 12 年的从业经验。

经过二十年的发展，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，为广大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 2025 年 6 月 30 日，工银瑞信（含子公司）旗下管理 265 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 2.15 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		
刘子豪	本基金的基金经理	2024 年 8 月 14 日	-	5 年	硕士研究生。曾任华兴证券量化研究员；2022 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2023 年 4 月 12 日至今，担任工银瑞信优选对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经

					理；2023 年 11 月 3 日至 2024 年 11 月 28 日，担任工银瑞信平衡回报 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2024 年 5 月 15 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；2024 年 6 月 4 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；2024 年 8 月 14 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；2025 年 2 月 7 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；2025 年 2 月 7 日至今，担任工银瑞信印度市场证券投资基金（LOF）基金经理；2025 年 2 月 7 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；2025 年 6 月 20 日至今，担任工银瑞信中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
刘伟琳	指数及量化投资部投资总监、本基金的基金经理	2023 年 11 月 9 日	2025 年 2 月 8 日	14 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 2025 年 2 月 8 日，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 2025 年 2 月 8 日，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 2025 年 2 月 8 日，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；2024 年 11 月 19 日至今，担任工银瑞信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2024 年 11 月 26 日至今，担任工银瑞信中证 A500 指数证券投资基金（自 2024 年 12 月 10 日起，变更为工银瑞信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2025 年 1 月 10 日至今，担任工银瑞信创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2025 年 3 月 12 日至今，担任工银瑞信创业板 50 指数证券投资基金（自 2025 年 4 月 3 日起，变更为工银瑞信创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金）基金经理；2025 年 3 月 26 日至今，担任工银瑞信国证港股通创新药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《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

律法规禁止的反向交易及交叉交易。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合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 12 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

2025 年上半年海外市场受美国政府政策及地缘政治冲突影响，波动较大。一季度，美国增长和就业边际走弱叠加美国关税政策的扰动，市场对美国经济衰退风险担忧加大，避险情绪升温。二季度以来，随着美国关税政策缓和、财政法案的推进等利好因素推动，市场风险偏好有所修复，美股三大股指普涨。

2025 年上半年 A 股市场呈现区间震荡走势。国内稳增长政策发力和新兴产业发展的带动下，国内经济延续去年四季度以来的平稳修复态势。一季度，DeepSeek 等科技突破提升微观主体信心和市场风险偏好，市场整体上行。二季度，美国关税对市场形成短暂冲击，但在稳增长、稳市场政策明确的背景下，A 股市场整体呈现逐渐修复态势。风格上，上半年成长板块占优。分行业来看，上半年中信一级行业中有色金属、银行、传媒涨幅居前，煤炭、房地产、食品饮料等板块跌幅居前。

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 12.30%，业绩比较基准收益率为 10.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外方面，主要经济体增长动能走弱但硬着陆风险较低。美国就业压力逐渐显现或将促使美联储重启降息。国内方面，外需走弱和政策脉冲趋缓对经济增长形成一定下行压力，但考虑到我国出口竞争优势，房地产调整对经济的影响程度或将降低，经济结构转型下新兴产业发展动能仍强，预计下半年经济增长呈现温和放缓态势。政策稳增长、稳市场方向明确，将进一步推动支持

经济结构转型升级。

短期市场对当前宏观经济状态定价较为充分，往后看经济增长短期存在一定的下行压力，但倾向于认为下行幅度和持续时间相对有限，同时考虑到市场流动性维持宽松，政策对经济和市场的支持，预计市场维持震荡格局，存在结构性机会。今年以来股市上涨较多的板块是微盘股、银行、海外算力链和创新药，体现出整体风险偏好扩张的特点，在盈利线索不清晰的情况下主题投资机会和交易性机会相对更多。

考虑到当前的估值水平和市场交投情况，我们认为下半年的投资机会或主要在以下三方面，一是在广谱利率下行背景下，经营稳健、分红率高的红利资产或仍具备配置性价比；二是以人工智能、创新药为代表的新兴产业发展空间较大；三是中期维度，顺周期龙头资产也在逐渐走出盈利底部。关注海外政策不确定性可能对市场带来的冲击。

国证 2000 指数凭借在工业制造、科技、医药等新兴成长行业的均衡布局及显著的小盘特征，有望在政策支持内需扩张与产业升级的经济环境下展现较高弹性。

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。

主任委员为分管运营的公司领导，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

本基金在本报告期内（2025 年 3 月 25 日至 2025 年 6 月 4 日）出现连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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报告期内基金的投资运作，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：工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,548,946.47	1,987,333.54
结算备付金		927,773.61	445,993.51
存出保证金		302,656.98	291,614.04
交易性金融资产	6.4.7.2	42,786,364.78	49,512,622.67
其中：股票投资		42,786,364.78	49,512,622.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	113,013.60	35,246.24
资产总计		45,678,755.44	52,272,810.00
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,460.09	21,970.56
应付托管费		2,560.50	3,417.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	26,659.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	20,230.17	23,237.42
负债合计		39,250.76	75,285.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	42,196,551.00	54,196,551.00
未分配利润	6.4.7.12	3,442,953.68	-1,999,026.11

净资产合计		45,639,504.68	52,197,524.89
负债和净资产总计		45,678,755.44	52,272,810.00

注： 1、本基金基金合同生效日为 2023 年 11 月 9 日。

2、报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0816 元，基金份额总额为 42,196,551.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,076,242.58	-2,102,943.47
1. 利息收入		7,516.58	7,076.33
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,516.58	7,076.33
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		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		7,733,822.92	-1,525,260.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,303,186.12	-1,674,608.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	93,160.54	-
股利收益	6.4.7.19	337,476.26	149,348.13
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,676,787.36	-445,227.68
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	11,690.44	-139,531.85
减：二、营业总支出		127,353.36	161,390.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	107,249.84	46,104.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,683.33	7,171.83

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		335. 81	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	3, 084. 38	108, 114. 13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 948, 889. 22	-2, 264, 334. 20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 948, 889. 22	-2, 264, 334. 20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5, 948, 889. 22	-2, 264, 334. 20

6.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	54, 196, 551. 00	-1, 999, 026. 11	52, 197, 524. 89
二、本期期初净资产	54, 196, 551. 00	-1, 999, 026. 11	52, 197, 524. 89
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-12, 000, 000. 00	5, 441, 979. 79	-6, 558, 020. 21
（一）、综合收益总额	-	5, 948, 889. 22	5, 948, 889. 22
（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）	-12, 000, 000. 00	-506, 909. 43	-12, 506, 909. 43
其中：1. 基金申购款	24, 000, 000. 00	842, 152. 13	24, 842, 152. 13
2. 基金赎回款	-36, 000, 000. 00	-1, 349, 061. 56	-37, 349, 061. 56
（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	42,196,551.00	3,442,953.68	45,639,504.68
项目	上年度可比期间 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	18,196,551.00	-675,435.37	17,521,115.63
二、本期期初净资产	18,196,551.00	-675,435.37	17,521,115.63
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-	-3,164,101.72	-3,164,101.72
（一）、综合收益总额	-	-2,264,334.20	-2,264,334.20
（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）	-	-899,767.52	-899,767.52
其中：1. 基金申购款	132,000,000.00	-19,864,130.01	112,135,869.99
2. 基金赎回款	-132,000,000.00	18,964,362.49	-113,035,637.51
（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	18,196,551.00	-3,839,537.09	14,357,013.91

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：

赵桂才
基金管理人负责人

王建
主管会计工作负责人

高文
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信国证 2000 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【2023】1313 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《工银瑞信国证 2000 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，《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 11 月 09 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 218,196,551.00 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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股

票) 交易印花税税率缴纳印花税, 受让方不再征收, 税率不变;

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定, 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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 自 2018 年 1 月 1 日起, 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(以下简称“资管产品运营业务”), 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税, 资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定, 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务, 按照以下规定确定销售额: 提供贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额; 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债

券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中若涉及境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,548,946.47
等于：本金	1,548,797.42
加：应计利息	149.05
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	1,548,946.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	40,571,830.69	-	42,786,364.78	2,214,534.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	40,571,830.69	-	42,786,364.78	2,214,534.09

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 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,457,920.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	2,457,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,457,920.00	-	-	-

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
IM2509	IM2509	2.00	2,462,240.00	4,320.00
合计				4,320.00
减：可抵销期货暂收款				4,320.00
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 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	37,397.36
待摊费用	75,616.24
合计	113,013.60

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	15,214.29
其中：交易所市场	15,214.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	4,193.97
预提信息披露费	657.54

IOPV 服务费	164.37
合计	20,230.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,196,551.00	54,196,551.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-36,000,000.00	-36,000,000.00
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	42,196,551.00	42,196,551.00

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

6.4.7.11 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	-1,150,906.92	-848,119.19	-1,999,026.11
本期期初	-1,150,906.92	-848,119.19	-1,999,026.11
本期利润	7,625,676.58	-1,676,787.36	5,948,889.22
本期基金份额交易产生的变动数	-677,096.47	170,187.04	-506,909.43
其中：基金申购款	1,279,386.09	-437,233.96	842,152.13
基金赎回款	-1,956,482.56	607,421.00	-1,349,061.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,797,673.19	-2,354,719.51	3,442,953.68

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,531.28
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	2,972.76
其他	12.54

合计	7,516.58
----	----------

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,431,451.07
股票投资收益——赎回差价收入	1,871,735.05
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	7,303,186.12

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	81,198,895.96
减：卖出股票成本总额	75,695,062.68
减：交易费用	72,382.21
买卖股票差价收入	5,431,451.07

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 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	37,349,061.56
减：现金支付赎回款总额	14,948,151.56
减：赎回股票成本总额	20,529,174.95
减：交易费用	—
赎回差价收入	1,871,735.05

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股指期货投资收益	93,160.54
----------	-----------

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	337,476.26
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	337,476.26

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,848,587.36
股票投资	-1,848,587.36
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	171,800.00
权证投资	-
期货投资	171,800.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,676,787.36

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,690.44
合计	11,690.44

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	187.41
信息披露费	657.54
证券出借违约金	-
银行费用	842.18
IOPV 服务费	164.37
注册登记费	1,232.88
合计	3,084.38

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

2025 年 6 月 13 日，本基金管理人发布《工银瑞信基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》，根据中国证券监督管理委员会证监许可【2025】228 号核准，瑞士银行有限公司（UBS AG）成为工银瑞信基金管理有限公司持股 5%以上股东，占本公司注册资本比例 20%。

本次股权变更后，基金管理人的注册资本保持不变，股权结构如下：中国工商银行股份有限公司 80%；瑞士银行有限公司（UBS AG）20%。本基金管理人股权变更工商变更登记手续已办理完毕。

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	107,249.84	46,104.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	29,200.53	2,325.45
应支付基金管理人的净管理费	78,049.31	43,779.32

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.45\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,683.33	7,171.83

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

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2023 年 11 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	44,385,900.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	8,997,600.00	-
报告期末持有的基金份额	35,388,300.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	83.87%	-

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,548,946.47	4,531.28	1,101,783.90	4,505.84

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

本报告期内，本基金存在由基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用的情形。

6.4.11 利润分配情况

本期无。如存在资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况，详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下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，将风险控制可在承受的范围之内。

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。

6.4.13.3 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 2025 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	1,548,946.47	-	-	-	1,548,946.47
结算备付金	927,773.61	-	-	-	927,773.61
存出保证金	302,656.98	-	-	-	302,656.98
交易性金融资产	-	-	-	42,786,364.78	42,786,364.78
其他资产	-	-	-	113,013.60	113,013.60
资产总计	2,779,377.06	-	-	42,899,378.38	45,678,755.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	16,460.09	16,460.09
应付托管费	-	-	-	2,560.50	2,560.50
其他负债	-	-	-	20,230.17	20,230.17
负债总计	-	-	-	39,250.76	39,250.76
利率敏感度缺口	2,779,377.06	-	-	42,860,127.62	45,639,504.68
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,987,333.54	-	-	-	1,987,333.54
结算备付金	445,993.51	-	-	-	445,993.51
存出保证金	291,614.04	-	-	-	291,614.04
交易性金融资产	-	-	-	49,512,622.67	49,512,622.67
其他资产	-	-	-	35,246.24	35,246.24
资产总计	2,724,941.09	-	-	49,547,868.91	52,272,810.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	21,970.56	21,970.56
应付托管费	-	-	-	3,417.65	3,417.65
应交税费	-	-	-	26,659.48	26,659.48
其他负债	-	-	-	23,237.42	23,237.42
负债总计	-	-	-	75,285.11	75,285.11
利率敏感度缺口	2,724,941.09	-	-	49,472,583.80	52,197,524.89

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	42,786,364.78	93.75	49,512,622.67	94.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	42,786,364.78	93.75	49,512,622.67	94.86

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月

			31 日)
	业绩比较基准增加 5%	2, 276, 677. 50	2, 492, 051. 16
	业绩比较基准减少 5%	-2, 276, 677. 50	-2, 492, 051. 16

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	42, 786, 364. 78	49, 512, 622. 67
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	42, 786, 364. 78	49, 512, 622. 67

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金融工具，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停、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金融工具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，确定相关金融工具的公允价值应
--

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	42,786,364.78	93.67
	其中：股票	42,786,364.78	93.67
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	2,476,720.08	5.42
8	其他各项资产	415,670.58	0.91
9	合计	45,678,755.44	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	—	—
B	采矿业	415,822.00	0.91

C	制造业	30,570,227.02	66.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	477,970.00	1.05
E	建筑业	433,870.00	0.95
F	批发和零售业	1,066,263.00	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	528,903.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,941,218.02	13.02
J	金融业	234,894.90	0.51
K	房地产业	313,766.00	0.69
L	租赁和商务服务业	489,322.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	1,000,198.24	2.19
N	水利、环境和公共设施管理业	587,948.60	1.29
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	725,962.00	1.59
S	综合	-	-
	合计	42,786,364.78	93.75

注：1、合计项不含可退替代款估值增值；

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

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002017	东信和平	15,800	291,194.00	0.64

2	688392	骄成超声	4,200	286,146.00	0.63
3	688088	虹软科技	5,680	274,060.00	0.60
4	300101	振芯科技	12,100	273,823.00	0.60
5	688049	炬芯科技	4,522	273,581.00	0.60
6	002315	焦点科技	5,900	269,571.00	0.59
7	300533	冰川网络	7,900	263,939.00	0.58
8	300850	新强联	7,300	261,486.00	0.57
9	600595	中孚实业	59,500	260,610.00	0.57
10	688800	瑞可达	5,235	257,562.00	0.56
11	688636	智明达	7,607	257,040.53	0.56
12	688503	聚和材料	6,103	252,603.17	0.55
13	300138	晨光生物	20,600	249,672.00	0.55
14	688519	南亚新材	5,446	243,980.80	0.53
15	688131	皓元医药	5,000	241,750.00	0.53
16	300027	华谊兄弟	89,800	240,664.00	0.53
17	603181	皇马科技	18,700	240,482.00	0.53
18	301330	熵基科技	8,840	238,945.20	0.52
19	688588	凌志软件	16,353	238,263.21	0.52
20	300806	斯迪克	14,400	237,600.00	0.52
21	300203	聚光科技	10,700	236,791.00	0.52
22	300400	劲拓股份	14,000	235,760.00	0.52
23	300972	万辰集团	1,300	234,312.00	0.51
24	301127	武汉天源	13,700	234,133.00	0.51
25	688787	海天瑞声	2,200	233,596.00	0.51
26	688579	山大地纬	20,857	233,389.83	0.51
27	301061	匠心家居	3,000	232,620.00	0.51
28	002970	锐明技术	4,700	232,180.00	0.51
29	002491	通鼎互联	40,600	230,608.00	0.51
30	300436	广生堂	6,400	229,760.00	0.50
31	002562	兄弟科技	46,900	228,872.00	0.50
32	600531	豫光金铅	29,500	228,330.00	0.50
33	301327	华宝新能	4,440	228,038.40	0.50
34	688590	新致软件	11,071	227,398.34	0.50
35	002380	科远智慧	9,300	227,385.00	0.50
36	688179	阿拉丁	17,817	226,632.24	0.50
37	002073	软控股份	25,400	225,806.00	0.49
38	300401	花园生物	14,800	225,108.00	0.49
39	300752	隆利科技	10,000	224,800.00	0.49
40	300292	吴通控股	46,100	224,507.00	0.49
41	301270	汉仪股份	4,700	224,002.00	0.49
42	000751	锌业股份	71,300	223,882.00	0.49
43	688205	德科立	3,564	223,427.16	0.49
44	688609	九联科技	21,327	223,293.69	0.49

45	603113	金能科技	32,100	222,453.00	0.49
46	688102	斯瑞新材	16,502	222,446.96	0.49
47	605376	博迁新材	5,800	222,314.00	0.49
48	002768	国恩股份	8,400	221,844.00	0.49
49	000823	超声电子	18,700	221,595.00	0.49
50	300197	节能铁汉	105,900	221,331.00	0.48
51	688365	光云科技	14,539	221,283.58	0.48
52	002448	中原内配	26,100	218,457.00	0.48
53	603270	金帝股份	8,500	218,365.00	0.48
54	002956	西麦食品	9,300	218,271.00	0.48
55	688550	瑞联新材	5,034	216,512.34	0.47
56	605319	无锡振华	6,300	215,208.00	0.47
57	603111	康尼机电	32,700	215,166.00	0.47
58	300174	元力股份	13,200	215,160.00	0.47
59	688222	成都先导	13,350	214,668.00	0.47
60	300267	尔康制药	68,200	214,148.00	0.47
61	600758	辽宁能源	57,200	213,928.00	0.47
62	688401	路维光电	6,152	213,474.40	0.47
63	601528	瑞丰银行	36,800	213,072.00	0.47
64	301488	豪恩汽电	3,000	212,400.00	0.47
65	688380	中微半导	7,834	212,301.40	0.47
66	688035	德邦科技	5,225	212,239.50	0.47
67	002243	力合科创	26,000	212,160.00	0.46
68	688403	汇成股份	20,390	211,852.10	0.46
69	600729	重庆百货	7,100	211,793.00	0.46
70	002606	大连电瓷	23,600	210,512.00	0.46
71	301367	瑞迈特	2,500	210,250.00	0.46
72	301393	昊帆生物	3,900	208,884.00	0.46
73	300241	瑞丰光电	36,600	208,620.00	0.46
74	603158	腾龙股份	26,200	208,552.00	0.46
75	688150	莱特光电	8,400	207,648.00	0.45
76	600169	太原重工	85,800	207,636.00	0.45
77	300011	鼎汉技术	27,700	206,919.00	0.45
78	000755	山西高速	42,400	206,488.00	0.45
79	688182	灿勤科技	7,400	203,944.00	0.45
80	603098	森特股份	20,000	203,800.00	0.45
81	000680	山推股份	22,700	203,619.00	0.45
82	688277	天智航	14,648	203,607.20	0.45
83	834599	同力股份	9,500	203,300.00	0.45
84	688209	英集芯	11,000	203,170.00	0.45
85	301262	海看股份	7,700	202,972.00	0.44
86	300525	博思软件	13,900	202,384.00	0.44
87	002303	美盈森	56,800	202,208.00	0.44

88	603727	博迈科	13,800	201,894.00	0.44
89	002864	盘龙药业	7,100	200,717.00	0.44
90	603966	法兰泰克	21,600	200,448.00	0.44
91	600826	兰生股份	24,400	200,080.00	0.44
92	301332	德尔玛	19,500	199,680.00	0.44
93	688302	海创药业	4,236	198,244.80	0.43
94	300523	辰安科技	8,600	198,230.00	0.43
95	688798	艾为电子	2,900	197,780.00	0.43
96	300145	南方泵业	56,300	197,050.00	0.43
97	300768	迪普科技	11,400	195,510.00	0.43
98	688685	迈信林	3,500	195,475.00	0.43
99	688306	均普智能	19,713	193,975.92	0.43
100	300632	光莆股份	14,500	193,575.00	0.42
101	688549	中巨芯	24,940	193,035.60	0.42
102	688362	甬矽电子	6,482	193,033.96	0.42
103	300559	佳发教育	16,300	192,340.00	0.42
104	688252	天德钰	7,874	191,968.12	0.42
105	300266	兴源环境	65,400	190,968.00	0.42
106	002912	中新赛克	8,000	190,800.00	0.42
107	603977	国泰集团	15,200	190,760.00	0.42
108	300360	炬华科技	12,100	190,575.00	0.42
109	600664	哈药股份	51,700	190,256.00	0.42
110	002011	盾安环境	16,400	190,240.00	0.42
111	002283	天润工业	31,900	190,124.00	0.42
112	300259	新天科技	53,500	189,925.00	0.42
113	688046	药康生物	12,600	189,504.00	0.42
114	000551	创元科技	14,700	188,895.00	0.41
115	688698	伟创电气	4,000	188,800.00	0.41
116	688663	新风光	6,941	187,059.95	0.41
117	603421	鼎信通讯	27,600	185,748.00	0.41
118	002538	司尔特	36,000	185,400.00	0.41
119	688208	道通科技	6,055	185,283.00	0.41
120	688007	光峰科技	12,800	185,088.00	0.41
121	600162	香江控股	112,000	182,560.00	0.40
122	605555	德昌股份	11,000	182,270.00	0.40
123	002454	松芝股份	23,600	182,192.00	0.40
124	600757	长江传媒	19,500	180,960.00	0.40
125	002895	川恒股份	8,000	180,480.00	0.40
126	688230	芯导科技	3,200	177,376.00	0.39
127	601616	广电电气	45,500	176,085.00	0.39
128	603901	永创智能	16,600	174,964.00	0.38
129	603633	徕木股份	19,800	172,062.00	0.38
130	603912	佳力图	19,600	170,520.00	0.37

131	300194	福安药业	40,000	169,200.00	0.37
132	002437	誉衡药业	59,300	169,005.00	0.37
133	002446	盛路通信	22,900	169,002.00	0.37
134	300978	东箭科技	15,100	168,516.00	0.37
135	002533	金杯电工	17,300	168,502.00	0.37
136	300320	海达股份	16,900	167,986.00	0.37
137	603109	神驰机电	6,000	167,640.00	0.37
138	300733	西菱动力	9,400	166,662.00	0.37
139	301221	光庭信息	3,200	166,304.00	0.36
140	600229	城市传媒	23,100	164,703.00	0.36
141	603012	创力集团	29,600	163,688.00	0.36
142	603058	永吉股份	18,700	163,438.00	0.36
143	688400	凌云光	5,850	161,284.50	0.35
144	600523	贵航股份	10,900	161,211.00	0.35
145	000682	东方电子	15,700	160,768.00	0.35
146	002452	长高电新	23,100	160,545.00	0.35
147	600420	国药现代	15,000	159,750.00	0.35
148	301339	通行宝	9,300	159,309.00	0.35
149	000531	穗恒运 A	25,900	159,285.00	0.35
150	300925	法本信息	6,300	158,634.00	0.35
151	688116	天奈科技	3,424	156,716.48	0.34
152	301370	国科恒泰	14,700	156,555.00	0.34
153	002396	星网锐捷	6,900	154,905.00	0.34
154	301211	亨迪药业	8,800	154,528.00	0.34
155	300497	富祥药业	17,100	153,729.00	0.34
156	600888	新疆众和	22,500	153,450.00	0.34
157	688001	华兴源创	6,058	153,085.66	0.34
158	002057	中钢天源	16,400	152,356.00	0.33
159	688127	蓝特光学	5,925	152,331.75	0.33
160	300662	科锐国际	5,100	151,521.00	0.33
161	603989	艾华集团	9,700	149,380.00	0.33
162	301368	丰立智能	2,400	148,392.00	0.33
163	688697	纽威数控	11,111	148,220.74	0.32
164	002971	和远气体	6,300	146,979.00	0.32
165	300358	楚天科技	18,800	146,640.00	0.32
166	688595	芯海科技	3,919	146,531.41	0.32
167	300110	华仁药业	45,000	145,350.00	0.32
168	300727	润禾材料	5,460	143,543.40	0.31
169	001288	运机集团	6,880	143,310.40	0.31
170	600351	亚宝药业	23,200	140,824.00	0.31
171	600880	博瑞传播	26,100	139,635.00	0.31
172	002150	通润装备	11,500	137,885.00	0.30
173	002035	华帝股份	21,900	137,751.00	0.30

174	688668	鼎通科技	2,190	136,787.40	0.30
175	920799	艾融软件	2,208	136,741.44	0.30
176	300382	斯莱克	8,900	135,369.00	0.30
177	601886	江河集团	22,000	135,300.00	0.30
178	600035	楚天高速	31,800	134,832.00	0.30
179	833575	康乐卫士	8,500	134,555.00	0.29
180	600266	城建发展	28,900	131,206.00	0.29
181	300151	昌红科技	10,400	128,024.00	0.28
182	688073	毕得医药	2,200	127,644.00	0.28
183	688207	格灵深瞳	8,400	126,840.00	0.28
184	002545	东方铁塔	14,100	125,349.00	0.27
185	603699	纽威股份	4,000	124,680.00	0.27
186	603055	台华新材	13,500	123,255.00	0.27
187	301408	华人健康	8,100	123,201.00	0.27
188	301349	信德新材	3,100	121,117.00	0.27
189	300908	仲景食品	4,000	120,440.00	0.26
190	301312	智立方	3,020	119,894.00	0.26
191	002003	伟星股份	10,900	118,919.00	0.26
192	603687	大胜达	16,000	118,880.00	0.26
193	000417	合百集团	20,900	118,294.00	0.26
194	688270	臻镭科技	2,534	117,983.04	0.26
195	300447	全信股份	7,500	117,525.00	0.26
196	300061	旗天科技	8,500	116,875.00	0.26
197	300131	英唐智控	15,100	115,968.00	0.25
198	002438	江苏神通	9,100	114,478.00	0.25
199	300582	英飞特	8,900	114,098.00	0.25
200	601137	博威合金	6,300	112,077.00	0.25
201	600724	宁波富达	24,500	111,475.00	0.24
202	300940	南极光	4,400	111,100.00	0.24
203	002170	芭田股份	10,800	110,700.00	0.24
204	300341	麦克奥迪	6,800	110,024.00	0.24
205	605277	新亚电子	6,100	109,556.00	0.24
206	300835	龙磁科技	2,600	108,238.00	0.24
207	301291	明阳电气	2,600	106,990.00	0.23
208	300698	万马科技	2,300	106,214.00	0.23
209	600738	丽尚国潮	18,300	106,140.00	0.23
210	430047	诺思兰德	4,800	102,720.00	0.23
211	603081	大丰实业	9,300	100,626.00	0.22
212	600368	五洲交通	23,400	99,216.00	0.22
213	002752	昇兴股份	17,700	98,589.00	0.22
214	688586	江航装备	8,600	96,750.00	0.21
215	003006	百亚股份	3,500	95,830.00	0.21
216	603929	亚翔集成	2,700	94,770.00	0.21

217	002421	达实智能	27,900	93,744.00	0.21
218	603950	长源东谷	3,700	92,611.00	0.20
219	301109	军信股份	6,220	92,553.60	0.20
220	000962	东方钨业	5,500	90,255.00	0.20
221	300219	鸿利智汇	13,300	89,376.00	0.20
222	300702	天宇股份	3,800	88,388.00	0.19
223	603387	基蛋生物	11,100	88,245.00	0.19
224	300430	诚益通	4,200	87,570.00	0.19
225	300926	博俊科技	3,200	84,704.00	0.19
226	000544	中原环保	10,400	84,552.00	0.19
227	300772	运达股份	6,500	83,720.00	0.18
228	301259	艾布鲁	1,700	83,096.00	0.18
229	000931	中关村	15,300	83,079.00	0.18
230	688533	上声电子	3,060	82,405.80	0.18
231	000920	沃顿科技	7,500	81,000.00	0.18
232	688259	创耀科技	2,030	80,489.50	0.18
233	002891	中宠股份	1,300	80,431.00	0.18
234	688486	龙迅股份	1,200	80,256.00	0.18
235	002953	日丰股份	7,600	78,888.00	0.17
236	688733	壹石通	4,000	75,760.00	0.17
237	002755	奥赛康	4,600	73,508.00	0.16
238	603360	百傲化学	3,260	73,252.20	0.16
239	002063	远光软件	11,100	66,045.00	0.14
240	600537	亿晶光电	22,300	65,562.00	0.14
241	300469	信息发展	1,900	59,641.00	0.13
242	002483	润邦股份	8,800	55,000.00	0.12
243	000922	佳电股份	4,800	54,624.00	0.12
244	688095	福昕软件	800	54,328.00	0.12
245	000727	冠捷科技	21,900	53,217.00	0.12
246	603628	清源股份	4,100	50,061.00	0.11
247	002662	峰璟股份	14,500	49,590.00	0.11
248	835368	连城数控	1,700	48,739.00	0.11
249	002515	金字火腿	8,200	48,052.00	0.11
250	600682	南京新百	7,100	47,712.00	0.10
251	601700	风范股份	10,200	47,634.00	0.10
252	300081	恒信东方	5,900	41,772.00	0.09
253	002997	瑞鹄模具	1,100	40,535.00	0.09
254	688258	卓易信息	800	38,744.00	0.08
255	000925	众合科技	5,000	38,400.00	0.08
256	688108	赛诺医疗	3,400	38,148.00	0.08
257	600496	精工钢构	11,500	36,800.00	0.08
258	603197	保隆科技	900	35,163.00	0.08
259	603668	天马科技	2,500	32,950.00	0.07

260	300873	海晨股份	1,300	26,247.00	0.06
261	301246	宏源药业	1,700	25,670.00	0.06
262	688382	益方生物	688	22,580.16	0.05
263	605228	神通科技	2,000	21,980.00	0.05
264	603323	苏农银行	3,890	21,822.90	0.05
265	300119	瑞普生物	1,000	19,420.00	0.04
266	002392	北京利尔	3,000	18,720.00	0.04
267	300858	科拓生物	1,200	18,708.00	0.04
268	600020	中原高速	3,900	18,642.00	0.04
269	002546	新联电子	3,200	17,568.00	0.04
270	600428	中远海特	2,800	17,500.00	0.04
271	002210	飞马国际	5,900	16,697.00	0.04
272	601518	吉林高速	5,500	15,070.00	0.03
273	300035	中科电气	800	13,504.00	0.03
274	836077	吉林碳谷	800	11,704.00	0.03
275	601022	宁波远洋	600	5,922.00	0.01
276	600345	长江通信	200	5,162.00	0.01
277	002928	华夏航空	600	4,986.00	0.01
278	300673	佩蒂股份	300	4,896.00	0.01
279	002183	怡亚通	900	4,149.00	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
无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000751	锌业股份	456,866.00	0.88
2	688205	德科立	428,655.43	0.82
3	601137	博威合金	385,053.00	0.74
4	002315	焦点科技	344,131.00	0.66
5	603713	密尔克卫	329,297.00	0.63
6	600537	亿晶光电	328,564.00	0.63
7	600388	龙净环保	326,118.00	0.62
8	600330	天通股份	322,830.00	0.62
9	600059	古越龙山	312,997.00	0.60
10	603267	鸿远电子	307,720.00	0.59
11	600976	健民集团	306,680.00	0.59
12	600525	ST 长园	303,742.00	0.58
13	688800	瑞可达	302,048.18	0.58
14	688382	益方生物	296,955.12	0.57
15	688298	东方生物	296,263.68	0.57

16	600864	哈投股份	296,211.00	0.57
17	300101	振芯科技	295,975.00	0.57
18	688391	钜泉科技	295,472.03	0.57
19	600419	天润乳业	287,678.00	0.55
20	688362	甬矽电子	284,675.78	0.55

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	603300	海南华铁	578,652.00	1.11
2	605136	丽人丽妆	480,801.00	0.92
3	002102	能特科技	448,156.00	0.86
4	600586	金晶科技	426,569.00	0.82
5	603267	鸿远电子	402,356.00	0.77
6	002330	得利斯	393,153.00	0.75
7	600728	佳都科技	382,626.00	0.73
8	688382	益方生物	381,377.66	0.73
9	601579	会稽山	379,302.00	0.73
10	601208	东材科技	374,846.00	0.72
11	600389	江山股份	374,390.00	0.72
12	603766	隆鑫通用	371,421.00	0.71
13	002929	润建股份	367,314.00	0.70
14	000917	电广传媒	364,218.00	0.70
15	603815	交建股份	363,160.00	0.70
16	600201	生物股份	357,905.00	0.69
17	688388	嘉元科技	352,785.64	0.68
18	600635	大众公用	352,159.00	0.67
19	600477	杭萧钢构	349,919.00	0.67
20	600059	古越龙山	346,357.00	0.66

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	77,638,477.10
卖出股票收入（成交）总额	81,198,895.96

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

关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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，深圳冰川网络股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局的处罚，洛阳新强联回转支承股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局的处罚。

本基金对上述证券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	302,656.98
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	37,397.36
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	415,670.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
262	161,055.54	39,101,833.00	92.67	3,094,718.00	7.33

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	工银瑞信基金管理有限公司	35,388,300.00	83.87
2	招商证券股份有限公司	1,930,046.00	4.57

3	中国银河证券股份有限公司	1,005,686.00	2.38
4	王丰锦	858,900.00	2.04
5	浙江量盈投资管理有限公司-量盈默顿专享私募证券投资基金	441,700.00	1.05
6	张群芳	391,800.00	0.93
7	杭州稻达私募基金管理有限公司-稻达盛禾 2 号私募证券投资基金	222,700.00	0.53
8	孙建国	150,000.00	0.36
9	张静堂	130,000.00	0.31
10	杨丽珍	114,400.00	0.27

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（2023 年 11 月 9 日）基金份额总额	218,196,551.00
本报告期期初基金份额总额	54,196,551.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,196,551.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人

自 2025 年 5 月 27 日起，郝炜先生担任工银瑞信基金管理有限公司督察长、风险官，不再担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理；朱碧艳女士不再担任工银瑞信基金管理有限公司督察长、风险官。详见工银瑞信基金管理有限公司于 2025 年 5 月 29 日发布的《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、基金托管人

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	3	68,390,281.76	43.06	9,296.92	43.27	-
国泰海通证券	1	32,733,637.77	20.61	4,446.17	20.69	-

中金公司	2	29,303,901.60	18.45	3,983.10	18.54	—
招商证券	2	17,049,758.56	10.73	2,316.93	10.78	—
申万宏源	1	6,290,023.31	3.96	854.61	3.98	—
华泰证券	2	3,625,814.65	2.28	493.00	2.29	—
中信证券	2	1,443,955.41	0.91	93.79	0.44	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
国联民生证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	3	—	—	—	—	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国新证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—

注：（一）选择标准

基金管理人根据法规要求制定公司管理制度，明确选择证券公司的标准和程序，建立准入与遴选管理机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力优秀，以及交易服务、研究服务能力强（研究服务能力评估不适用于被动股票型基金）的证券公司参与证券交易。

（二）选择程序

根据以上标准，基金管理人证券公司进行考察、选择和确定，根据对其交易服务或研究服务的评估结果，决定是否作为选用的证券公司，并开展持续的动态管理。

本报告期内本基金退租方正证券 2 个交易单元，中泰证券 1 个交易单元。

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(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于工银瑞信国证 2000 交易型开放	中国证监会规定的媒介	2025 年 2 月 11 日

	式指数证券投资基金变更基金经理的公告		
2	工银瑞信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 31 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 4 月 11 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 5 月 10 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于暂停万和证券股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 5 月 11 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 5 月 24 日
7	工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 5 月 29 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 5 月 31 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 6 月 13 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101–20250630	44,385,900.00	–	8,997,600.00	35,388,300.00	83.87
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国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信国证 2000 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.icbcubs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日