工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 其他指标 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
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 43
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 57

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 57
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 57
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 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
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 59

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
8.3 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 59

§9 开放式基金份额变动 59

§10 重大事件揭示 60

10.1 基金份额持有人大会决议 60
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 60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 61
10.8 其他重大事件 62

§11 影响投资者决策的其他重要信息 63

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 63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 63

§12 备查文件目录 63

12.1 备查文件目录 63
12.2 存放地点 64
12.3 查阅方式 64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证500ETF工银
场内简称	工银500、中证500ETF工银
基金主代码	510530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年10月17日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,979,379.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年1月3日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郝炜	许俊
	联系电话	400-811-9999	010-66596688
	电子邮箱	customerservice@icbcubs.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街5号、甲5号9层甲5号901	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层	北京市西城区复兴门内大街1号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	赵桂才	葛海蛟

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.icbcubs.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026年1月1日 - 2026年6月30日)
本期已实现收益	56,555,146.51
本期利润	90,754,895.97
加权平均基金份额本期利润	1.8552
本期加权平均净值利润率	20.54%
本期基金份额净值增长率	23.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)
期末可供分配利润	175,438,039.98
期末可供分配基金份额利润	3.9004
期末基金资产净值	450,641,578.84
期末基金份额净值	10.0188
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)
基金份额累计净值增长率	93.69%

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	20.72%	1.64%	18.56%	1.65%	2.16%	-0.01%
过去六个月	23.57%	1.65%	20.97%	1.66%	2.60%	-0.01%
过去一年	58.85%	1.42%	52.68%	1.42%	6.17%	0.00%
过去三年	61.16%	1.47%	50.55%	1.49%	10.61%	-0.02%
过去五年	45.73%	1.35%	32.65%	1.36%	13.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	93.69%	1.35%	79.25%	1.37%	14.44%	-0.02%

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

注：1、本基金基金合同于 2019 年 10 月 17 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是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832人，86%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232人，投资人员平均拥有13年的从业经验。

经过二十一年的发展，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2026年6月30日，工银瑞信（含子公司）旗下管理285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2.56万亿元，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	2025年2月7日	-	6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2026年7月1日，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；2025年7月14日至今，担任工银瑞信中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2026年3月10日至今，担任工银瑞信中证1000指数增强型证券投资基金基金经理；2026年3月18日至今，担任工银瑞信中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2026年5月21日至今，担任工银瑞信中证红利低波动100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11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

海外方面，年初至2月末，海外经济延续增长动能平稳修复、通胀温和的态势。3月以来中东局势持续升级并带动油价飙升，通胀预期抬升下，市场对于主要海外央行货币政策宽松预期下降。

国内方面，经济增长开局良好，油价上行、AI产业带动和行业供需调整，促使广谱价格出现明显抬升。进入二季度，经济增长动能有所放缓，外需维持强劲，内需边际走弱。

市场方面，上半年权益市场主要指数悉数上涨。“涨价”主线贯穿1-2月市场，3月中东局势升级，风险偏好、流动性预期进一步下降背景下，指数有所回调。4月以来AI浪潮持续演绎下，科技引领市场大幅上涨。A股方面，4月以来中东局势降温，市场显著修复，创业板指、科创50更持续创新高。整体来看，上半年成长风格显著占优，申万一级行业中电子、通信领涨。

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23.57%，业绩比较基准收益率为20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外经济方面，油价中枢抬升推高海外通胀读数、一定程度拖累经济增长动能，但预计仍在可控幅度内。3月以来美伊局势持续升级并带动油价飙升，通胀预期抬升下，市场对于主要海外央行货币政策宽松预期下降，日欧央行均已启动加息，美联储货币政策更多边走边看，但预计年内加息概率不大。

国内方面，预计2026年经济大幅下行风险不大，名义增长企稳回升。外需方面，主要国家财政宽松趋势仍在，中国产业链优势更加凸显，出口品类附加值更高、出口区域更加广泛和分散。内需方面，财政政策托底力量仍在，房地产调整过程中逐渐寻底。宏观政策在保持力度的同时更注重提质增效，经济增长的质量将有所提升。

短期波动可能加大，但市场上行趋势仍在。一是机构和居民资产配置的需求仍在，权益资产收益风险角度仍有性价比。二是A股整体上市公司盈利处在上行周期。市场盈利改善主要来自于：一方面2024年Q4上市公司盈利触底,2025年以来随着盈利动能内生性修复和产业景气周期带动，企业盈利逐渐进入上行周期；另一方面以AI算力为代表的新一轮产业景气周期业绩兑现高增长。三是估值方面，虽然静态估值处于相对高位，但考虑到一是国内稳增长政策将逐渐托底经济，二是国内高质量发展的方向没有改变，新能源、半导体、人工智能等产业政策持续利好相关行业，都对估值形成支持。风险方面，一是AI相关板块估值处于高位，二是油价等因素可能造成海外流动性预期波动。

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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,009,154.29	19,482,871.07
结算备付金		6,897,352.71	2,688,557.90
存出保证金		3,372,431.19	2,485,411.33
交易性金融资产	6.4.7.2	420,634,424.76	352,437,854.68
其中：股票投资		420,634,424.76	352,437,854.68
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		74,279.10	139,664.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		450,987,642.05	377,234,359.60
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026年6月30日**	**上年度末 2025年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	0.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		156,673.48	136,572.23
应付托管费		24,371.46	21,244.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		63,559.72	42,200.31

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	101,458.55	174,309.26
负债合计		346,063.21	374,326.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	232,660,668.38	240,419,579.48
未分配利润	6.4.7.12	217,980,910.46	136,440,453.18
净资产合计		450,641,578.84	376,860,032.66
负债和净资产总计		450,987,642.05	377,234,359.60

注：1、本基金基金合同生效日为2019年10月17日。

2、报告截止日2026年6月30日，基金份额净值为人民币10.0188元，基金份额总额为44,979,379.00份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
一、营业总收入		91,987,651.52	17,951,605.69
1.利息收入		65,217.85	9,873.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,217.85	9,873.54
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）		57,590,213.16	5,156,846.13
其中：股票投资收益	6.4.7.14	51,324,257.45	1,866,843.77
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	3,629,539.55	-113,017.97
股利收益	6.4.7.19	2,636,416.16	3,403,020.33
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	34,199,749.46	12,593,810.04

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	132,471.05	191,075.98
减：二、营业总支出		1,232,755.55	1,022,622.72
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	985,476.25	784,190.33
2．托管费	6.4.10.2.2	153,296.37	121,985.13
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		13,071.04	-
8．其他费用	6.4.7.23	80,911.89	116,447.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90,754,895.97	16,928,982.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		90,754,895.97	16,928,982.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		90,754,895.97	16,928,982.97

6.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	240,419,579.48	136,440,453.18	376,860,032.66
二、本期期初净资产	240,419,579.48	136,440,453.18	376,860,032.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,758,911.10	81,540,457.28	73,781,546.18
（一）、综合收益总额	-	90,754,895.97	90,754,895.97
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	-7,758,911.10	-9,214,438.69	-16,973,349.79

减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	36,208,251.77	26,367,478.92	62,575,730.69
2.基金赎回款	-43,967,162.87	-35,581,917.61	-79,549,080.48
（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	232,660,668.38	217,980,910.46	450,641,578.84

项目	上年度可比期间 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	294,731,957.19	49,446,581.07	344,178,538.26
二、本期期初净资产	294,731,957.19	49,446,581.07	344,178,538.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	23,276,733.27	20,286,041.94	43,562,775.21
（一）、综合收益总额	-	16,928,982.97	16,928,982.97
（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）	23,276,733.27	3,357,058.97	26,633,792.24
其中：1.基金申购款	111,211,059.04	18,891,116.30	130,102,175.34
2.基金赎回款	-87,934,325.77	-15,534,057.33	-103,468,383.10
（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	318,008,690.46	69,732,623.01	387,741,313.47

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　　王建　　卢佳

基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]220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《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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，《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年10月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,080,968,281.00份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号—定期报告的内容与格式》、《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》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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

（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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第826号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自2026年1月1日至2027年12月31日，对公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自2026年1月1日至2027年12月31日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

根据财政部、税务总局公告2025年第11号文《财政部　税务总局关于黄金有关税收政策的公告》的规定，会员单位或客户通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，卖出方会员单位或客户销售标准黄金时，免征增值税；

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》及财政部、税务总局公告2026年第10号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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 2026年6月30日
活期存款	20,009,154.29
等于：本金	20,007,260.51
加：应计利息	1,893.78
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	20,009,154.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		327,105,412.37	-	420,634,424.76	93,529,012.39
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		327,105,412.37	-	420,634,424.76	93,529,012.39

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 2026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	25,237,488.00	-	-	-
其中：股指期货投资	25,237,488.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,237,488.00	-	-	-

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
IC2609	IC2609	8.00	14,018,240.00	1,545,152.00
IC2612	IC2612	8.00	13,667,840.00	903,440.00
合计				2,448,592.00
减：可抵销期货暂收款				2,448,592.00
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

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026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	23,603.21
其中：交易所市场	23,603.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	8,430.98
预提信息披露费	59,507.37
IOPV服务费	9,916.99
合计	101,458.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,479,379.00	240,419,579.48
本期申购	7,000,000.00	36,208,251.77
本期赎回（以“-”号填列）	-8,500,000.00	-43,967,162.87
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	44,979,379.00	232,660,668.38

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	125,378,569.74	11,061,883.44	136,440,453.18
本期期初	125,378,569.74	11,061,883.44	136,440,453.18
本期利润	56,555,146.51	34,199,749.46	90,754,895.97
本期基金份额交易产生的变动数	-6,495,676.27	-2,718,762.42	-9,214,438.69

其中：基金申购款	19,206,522.33	7,160,956.59	26,367,478.92
基金赎回款	-25,702,198.60	-9,879,719.01	-35,581,917.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	175,438,039.98	42,542,870.48	217,980,910.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	35,057.54
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	30,085.81
其他	74.50
合计	65,217.85

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	43,377,629.64
股票投资收益——赎回差价收入	7,946,627.81
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	51,324,257.45

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	114,790,383.92
减：卖出股票成本总额	71,310,402.18
减：交易费用	102,352.10
买卖股票差价收入	43,377,629.64

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	79,549,080.48
减：现金支付赎回款总额	39,796,931.48
减：赎回股票成本总额	31,805,521.19
减：交易费用	-

赎回差价收入	7,946,627.81

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	3,629,539.55

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,636,416.16
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,636,416.16

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	33,023,917.46
股票投资	33,023,917.46
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	1,175,832.00
权证投资	-

期货投资	1,175,832.00
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	34,199,749.46

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	132,471.05
合计	132,471.05

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	8,430.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,943.88
存托服务费	112.67
IOPV服务费	9,916.99
合计	80,911.89

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、关联关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	985,476.25	784,190.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	287,529.06	146,693.15
应支付基金管理人的净管理费	697,947.19	637,497.18

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×0.45%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	153,296.37	121,985.13

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×0.07%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	13,139,300.00	29.21	14,644,200.00	31.51
瑞士银行有限公司（UBS AG）	-	-	4,700.00	0.01

注：本章节列示的关联方投资本基金时的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	20,009,154.29	35,057.54	9,099,908.44	8,040.81

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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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（2026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

688783	西安奕材	2025年10月20日	9个月	新股锁定	8.62	57.42	15,900	137,058.00	912,978.00	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股锁定	104.66	768.89	965	100,996.90	741,978.85	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股锁定	46.08	463.33	697	32,117.76	322,941.01	-
688765	禾元生物	2025年10月16日	9个月	新股锁定	29.06	48.56	6,361	184,850.66	308,890.16	-
688759	必贝特	2025年10月21日	9个月	新股锁定	17.78	30.65	8,107	144,142.46	248,479.55	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股锁定	81.88	1,584.33	114	9,334.32	180,613.62	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股锁定	22.68	42.16	4,277	97,002.36	180,318.32	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股锁定	10.11	10.11	13,227	133,724.97	133,724.97	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	新股锁定	83.06	126.45	1,043	86,631.58	131,887.35	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定	19.68	141.49	663	13,047.84	93,807.87	-
688818	电科蓝	2026年2月3	6个月	新股锁	9.47	70.14	1,153	10,918.91	80,871.42	-

	天	日		定						
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股锁定	44.56	468.67	166	7,396.96	77,799.22	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定	69.66	160.06	431	30,023.46	68,985.86	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股锁定	10.12	27.73	2,186	22,122.32	60,617.78	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	5,668	57,303.48	57,303.48	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定	92.18	463.15	98	9,033.64	45,388.70	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股锁定	17.70	84.32	291	5,150.70	24,537.12	-
688811	有研	2026年4	6个月	新股	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

	复材	月1日		锁定						
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定	27.19	31.31	480	13,051.20	15,028.80	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股锁定	30.38	38.99	338	10,268.44	13,178.62	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股锁定	53.26	58.74	194	10,332.44	11,395.56	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
688816	易思	2026年2	6个月	新股	55.95	57.10	159	8,896.05	9,078.90	-

	维	月4日		锁定						
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	364	4,069.52	6,402.76	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026年1月27日	6个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年8月30日	重大事项	0.00	-	-	202,200	517,907.01	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下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。

6.4.13.3 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约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 2026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	20,009,154.29	-	-	-	20,009,154.29
结算备付金	6,897,352.71	-	-	-	6,897,352.71
存出保证金	3,372,431.19	-	-	-	3,372,431.19
交易性金融资产	-	-	-	420,634,424.76	420,634,424.76
应收清算款	-	-	-	74,279.10	74,279.10

资产总计	30,278,938.19	-	-	420,708,703.86	450,987,642.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	156,673.48	156,673.48
应付托管费	-	-	-	24,371.46	24,371.46
应交税费	-	-	-	63,559.72	63,559.72
其他负债	-	-	-	101,458.55	101,458.55
负债总计	-	-	-	346,063.21	346,063.21
利率敏感度缺口	30,278,938.19	-	-	420,362,640.65	450,641,578.84
上年度末 2025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	19,482,871.07	-	-	-	19,482,871.07
结算备付金	2,688,557.90	-	-	-	2,688,557.90
存出保证金	2,485,411.33	-	-	-	2,485,411.33
交易性金融资产	-	-	-	352,437,854.68	352,437,854.68
应收清算款	-	-	-	139,664.62	139,664.62
资产总计	24,656,840.30	-	-	352,577,519.30	377,234,359.60
负债					
应付清算款	-	-	-	0.58	0.58
应付管理人报酬	-	-	-	136,572.23	136,572.23
应付托管费	-	-	-	21,244.56	21,244.56
应交税费	-	-	-	42,200.31	42,200.31
其他负债	-	-	-	174,309.26	174,309.26
负债总计	-	-	-	374,326.94	374,326.94
利率敏感度缺口	24,656,840.30	-	-	352,203,192.36	376,860,032.66

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 2026年6月30日		上年度末 2025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	420,634,424.76	93.34	352,437,854.68	93.52
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	420,634,424.76	93.34	352,437,854.68	93.52

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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准增加5%	22,429,104.83	18,721,779.58
	业绩比较基准减少5%	-22,429,104.83	-18,721,779.58

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	416,595,529.55	350,196,701.72
第二层次	191,028.45	-
第三层次	3,847,866.76	2,241,152.96
合计	420,634,424.76	352,437,854.68

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	420,634,424.76	93.27
	其中：股票	420,634,424.76	93.27
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	26,906,507.00	5.97
8	其他各项资产	3,446,710.29	0.76
9	合计	450,987,642.05	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	1,358,469.00	0.30
B	采矿业	12,815,654.70	2.84
C	制造业	313,803,470.23	69.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,083,855.20	2.24
E	建筑业	2,444,657.50	0.54
F	批发和零售业	7,901,905.79	1.75
G	交通运输、仓储和邮政业	5,049,670.00	1.12
H	住宿和餐饮业	304,031.00	0.07

I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,771,402.56	5.94
J	金融业	22,777,762.97	5.05
K	房地产业	1,675,539.00	0.37
L	租赁和商务服务业	4,253,818.20	0.94
M	科学研究和技术服务业	3,005,270.36	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	1,433,569.40	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	976,021.40	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,946,835.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	416,601,932.31	92.45

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	36,149.82	0.01
C	制造业	3,803,730.72	0.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	191,028.45	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	4,032,492.45	0.89

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	688498	源杰科技	3,711	6,998,946.00	1.55
2	300604	长川科技	16,500	5,633,430.00	1.25
3	001309	德明利	5,800	5,468,820.00	1.21
4	688347	华虹宏力	15,247	5,127,566.10	1.14
5	688120	华海清科	14,555	4,689,329.90	1.04
6	002281	光迅科技	17,800	4,573,532.00	1.01
7	002008	大族激光	30,400	4,563,344.00	1.01
8	300857	协创数据	12,640	4,296,336.00	0.95
9	300136	信维通信	35,800	4,269,150.00	0.95
10	688361	中科飞测	9,265	3,983,950.00	0.88
11	300475	香农芯创	12,100	3,630,000.00	0.81
12	300223	北京君正	14,200	3,534,380.00	0.78
13	002436	兴森科技	62,600	3,189,470.00	0.71
14	300285	国瓷材料	29,400	3,033,492.00	0.67
15	300054	鼎龙股份	28,200	2,988,354.00	0.66
16	600105	永鼎股份	43,100	2,908,388.00	0.65
17	300666	江丰电子	7,800	2,875,080.00	0.64
18	688777	中控技术	23,169	2,722,357.50	0.60
19	688200	华峰测控	5,131	2,694,288.10	0.60
20	300757	罗博特科	4,300	2,661,700.00	0.59
21	000021	深科技	40,600	2,609,362.00	0.58
22	688037	芯源微	5,770	2,533,318.50	0.56
23	002851	麦格米特	14,900	2,490,982.00	0.55
24	300548	长芯博创	8,700	2,418,600.00	0.54
25	688019	安集科技	7,083	2,404,395.18	0.53
26	601869	长飞光纤	4,400	2,401,960.00	0.53

27	300346	南大光电	25,600	2,371,840.00	0.53
28	002409	雅克科技	10,489	2,354,780.50	0.52
29	300567	精测电子	7,200	2,286,720.00	0.51
30	600498	烽火通信	30,100	2,215,360.00	0.49
31	002407	多氟多	43,800	2,200,074.00	0.49
32	002185	华天科技	97,900	2,184,149.00	0.48
33	002138	顺络电子	29,700	2,171,070.00	0.48
34	688313	仕佳光子	11,696	2,159,666.40	0.48
35	688002	睿创微纳	13,619	2,106,723.11	0.47
36	300395	菲利华	15,600	2,086,188.00	0.46
37	300620	光库科技	5,500	2,080,100.00	0.46
38	600879	航天电子	97,230	2,070,026.70	0.46
39	300390	天华新能	21,340	1,995,503.40	0.44
40	688469	芯联集成	185,277	1,965,788.97	0.44
41	301526	国际复材	41,600	1,941,472.00	0.43
42	300373	扬杰科技	12,200	1,918,206.00	0.43
43	688017	绿的谐波	4,568	1,908,784.48	0.42
44	002273	水晶光电	51,300	1,820,124.00	0.40
45	300058	蓝色光标	132,220	1,819,347.20	0.40
46	300037	新宙邦	19,540	1,814,289.00	0.40
47	688172	燕东微	20,971	1,754,433.86	0.39
48	603256	宏和科技	6,600	1,751,178.00	0.39
49	300751	迈为股份	6,100	1,723,006.00	0.38
50	688702	盛科通信	4,389	1,711,666.11	0.38
51	301377	鼎泰高科	3,100	1,707,790.00	0.38
52	605358	立昂微	21,800	1,691,680.00	0.38
53	600988	赤峰黄金	61,400	1,616,048.00	0.36
54	688099	晶晨股份	15,596	1,604,828.40	0.36
55	605589	圣泉集团	24,900	1,582,893.00	0.35
56	600885	宏发股份	45,771	1,578,641.79	0.35
57	002738	中矿资源	26,680	1,573,853.20	0.35
58	002126	银轮股份	31,300	1,558,740.00	0.35
59	000960	锡业股份	36,500	1,558,185.00	0.35
60	600392	盛和资源	51,800	1,542,086.00	0.34
61	000831	中国稀土	27,500	1,525,975.00	0.34
62	600601	方正科技	110,200	1,525,168.00	0.34
63	001389	广合科技	6,400	1,518,400.00	0.34
64	600141	兴发集团	31,000	1,456,070.00	0.32
65	600378	昊华科技	19,200	1,447,296.00	0.32
66	002812	恩捷股份	21,600	1,445,256.00	0.32
67	300570	太辰光	5,800	1,430,918.00	0.32
68	301358	湖南裕能	18,600	1,411,182.00	0.31
69	601179	中国西电	94,100	1,403,972.00	0.31

70	002195	岩山科技	209,100	1,367,514.00	0.30
71	600497	驰宏锌锗	111,620	1,351,718.20	0.30
72	688234	天岳先进	7,780	1,349,907.80	0.30
73	002850	科达利	7,100	1,344,030.00	0.30
74	002261	拓维信息	46,400	1,299,664.00	0.29
75	600157	永泰能源	804,500	1,295,245.00	0.29
76	600711	盛屯矿业	113,800	1,248,386.00	0.28
77	688629	华丰科技	6,636	1,244,316.36	0.28
78	002340	格林美	187,800	1,241,358.00	0.28
79	600909	华安证券	110,980	1,232,987.80	0.27
80	600143	金发科技	78,900	1,219,005.00	0.27
81	300017	网宿科技	91,900	1,195,619.00	0.27
82	000783	长江证券	122,200	1,191,450.00	0.26
83	688411	海博思创	4,086	1,189,843.20	0.26
84	688052	纳芯微	4,116	1,186,683.96	0.26
85	003031	中瓷电子	6,580	1,186,374.00	0.26
86	002131	利欧股份	249,300	1,184,175.00	0.26
87	002821	凯莱英	7,300	1,182,600.00	0.26
88	600352	浙江龙盛	95,800	1,160,138.00	0.26
89	601555	东吴证券	146,320	1,158,854.40	0.26
90	002203	海亮股份	50,700	1,158,495.00	0.26
91	301200	大族数控	3,200	1,154,080.00	0.26
92	301611	珂玛科技	6,400	1,152,448.00	0.26
93	002966	苏州银行	164,860	1,147,425.60	0.25
94	603659	璞泰来	39,410	1,140,131.30	0.25
95	601233	桐昆股份	52,600	1,138,790.00	0.25
96	688027	国盾量子	2,257	1,137,550.57	0.25
97	300339	润和软件	29,400	1,132,194.00	0.25
98	688220	翱捷科技	9,101	1,131,436.32	0.25
99	300759	康龙化成	38,000	1,099,340.00	0.24
100	688213	思特威	10,266	1,099,180.62	0.24
101	688578	艾力斯	9,861	1,076,821.20	0.24
102	688122	西部超导	17,077	1,072,606.37	0.24
103	688235	百济神州	4,158	1,058,668.38	0.23
104	603308	应流股份	17,500	1,057,000.00	0.23
105	002472	双环传动	25,200	1,046,052.00	0.23
106	601108	财通证券	119,700	1,035,405.00	0.23
107	300207	欣旺达	54,500	1,034,955.00	0.23
108	300001	特锐德	27,300	1,032,759.00	0.23
109	002517	恺英网络	63,000	1,023,750.00	0.23
110	603129	春风动力	4,000	1,023,200.00	0.23
111	002797	第一创业	154,600	1,015,722.00	0.23
112	300458	全志科技	25,716	1,014,753.36	0.23

113	688385	复旦微电	14,206	1,012,745.74	0.22
114	002601	龙佰集团	61,400	1,011,872.00	0.22
115	688387	信科移动	50,601	1,003,923.84	0.22
116	601958	金钼股份	35,600	1,000,716.00	0.22
117	300115	长盈精密	35,100	980,694.00	0.22
118	601198	东兴证券	71,500	971,685.00	0.22
119	688301	奕瑞科技	7,781	964,844.00	0.21
120	002155	湖南黄金	40,380	963,870.60	0.21
121	000703	恒逸石化	70,300	953,971.00	0.21
122	688322	奥比中光	7,284	950,926.20	0.21
123	601991	大唐发电	132,900	940,932.00	0.21
124	600563	法拉电子	4,900	934,920.00	0.21
125	002465	海格通信	73,200	934,764.00	0.21
126	300454	深信服	9,700	933,140.00	0.21
127	603179	新泉股份	18,580	922,497.00	0.20
128	603156	养元饮品	18,700	917,609.00	0.20
129	601665	齐鲁银行	158,700	915,699.00	0.20
130	002056	横店东磁	30,000	914,400.00	0.20
131	600884	杉杉股份	66,400	899,720.00	0.20
132	603650	彤程新材	9,100	891,618.00	0.20
133	300024	机器人	46,100	891,113.00	0.20
134	600707	彩虹股份	52,700	890,103.00	0.20
135	002402	和而泰	34,200	883,386.00	0.20
136	002130	沃尔核材	46,400	879,744.00	0.20
137	601162	天风证券	260,200	876,874.00	0.19
138	000060	中金岭南	114,600	867,522.00	0.19
139	002429	兆驰股份	83,400	866,526.00	0.19
140	300012	华测检测	62,100	860,706.00	0.19
141	603379	三美股份	11,300	857,557.00	0.19
142	688676	金盘科技	10,123	856,810.72	0.19
143	000878	云南铜业	53,700	852,756.00	0.19
144	688331	荣昌生物	6,540	851,900.40	0.19
145	002432	九安医疗	12,000	848,160.00	0.19
146	300496	中科创达	13,700	846,523.00	0.19
147	601099	太平洋	251,000	845,870.00	0.19
148	600109	国金证券	95,600	839,368.00	0.19
149	002271	东方雨虹	70,500	836,835.00	0.19
150	000893	亚钾国际	20,400	834,156.00	0.19
151	002414	高德红外	62,900	834,054.00	0.19
152	300623	捷捷微电	18,500	832,315.00	0.18
153	000034	神州数码	29,920	830,280.00	0.18
154	002335	科华数据	19,415	824,166.75	0.18
155	002444	巨星科技	26,500	824,150.00	0.18

156	300474	景嘉微	13,600	822,528.00	0.18
157	603688	石英股份	9,950	821,969.50	0.18
158	002487	大金重工	14,100	817,377.00	0.18
159	600298	安琪酵母	22,500	814,500.00	0.18
160	600256	广汇能源	164,700	813,618.00	0.18
161	603979	金诚信	13,700	808,711.00	0.18
162	600060	海信视像	29,001	808,257.87	0.18
163	000661	长春高新	12,100	805,860.00	0.18
164	000733	振华科技	14,200	804,288.00	0.18
165	688728	格科微	38,197	803,664.88	0.18
166	301536	星宸科技	6,200	798,002.00	0.18
167	300763	锦浪科技	8,800	795,080.00	0.18
168	689009	九号公司	20,797	793,405.55	0.18
169	002756	永兴材料	14,000	792,960.00	0.18
170	600021	上海电力	52,000	783,640.00	0.17
171	300748	金力永磁	25,400	783,590.00	0.17
172	601128	常熟银行	134,613	783,447.66	0.17
173	600699	均胜电子	36,180	781,849.80	0.17
174	688266	泽璟制药	6,693	780,805.38	0.17
175	601696	中银证券	61,500	777,975.00	0.17
176	002025	航天电器	10,200	777,444.00	0.17
177	601577	长沙银行	89,000	775,190.00	0.17
178	002078	太阳纸业	61,800	771,882.00	0.17
179	601615	明阳智能	66,700	771,719.00	0.17
180	300073	当升科技	16,000	768,640.00	0.17
181	300142	沃森生物	58,900	765,111.00	0.17
182	002157	正邦科技	272,100	764,601.00	0.17
183	603920	世运电路	15,900	763,836.00	0.17
184	603606	东方电缆	18,400	763,784.00	0.17
185	300919	中伟新材	17,400	761,250.00	0.17
186	300432	富临精工	37,800	759,402.00	0.17
187	688343	云天励飞	9,298	759,274.68	0.17
188	000423	东阿阿胶	16,700	757,512.00	0.17
189	603087	甘李药业	13,100	743,556.00	0.16
190	002252	上海莱士	170,100	738,234.00	0.16
191	688599	天合光能	52,037	734,762.44	0.16
192	300724	捷佳伟创	10,300	727,180.00	0.16
193	688169	石头科技	7,649	726,425.53	0.16
194	000728	国元证券	96,500	722,785.00	0.16
195	300953	震裕科技	5,360	716,632.00	0.16
196	688608	恒玄科技	4,198	701,863.62	0.16
197	603119	浙江荣泰	10,500	696,570.00	0.15
198	002064	华峰化学	73,300	695,617.00	0.15

199	002831	裕同科技	19,165	681,507.40	0.15
200	000786	北新建材	37,500	678,375.00	0.15
201	001203	大中矿业	22,600	676,870.00	0.15
202	603290	斯达半导	4,380	669,877.20	0.15
203	688375	国博电子	6,420	669,606.00	0.15
204	300677	英科医疗	17,000	665,890.00	0.15
205	300679	电连技术	11,100	665,889.00	0.15
206	688180	君实生物	19,650	664,563.00	0.15
207	600171	上海贝岭	20,800	664,352.00	0.15
208	300383	光环新网	53,100	660,564.00	0.15
209	300972	万辰集团	3,800	658,958.00	0.15
210	688187	时代电气	9,591	658,518.06	0.15
211	000519	中兵红箭	30,800	648,956.00	0.14
212	688065	凯赛生物	13,498	645,879.30	0.14
213	603806	福斯特	38,400	644,736.00	0.14
214	688018	乐鑫科技	5,028	643,181.76	0.14
215	002673	西部证券	98,900	641,861.00	0.14
216	600177	雅戈尔	85,200	641,556.00	0.14
217	600516	方大炭素	103,700	639,829.00	0.14
218	603160	汇顶科技	10,300	635,613.00	0.14
219	000559	万向钱潮	49,000	633,570.00	0.14
220	601699	潞安环能	44,200	631,176.00	0.14
221	600642	申能股份	72,200	630,306.00	0.14
222	000623	吉林敖东	35,350	626,755.50	0.14
223	688568	中科星图	15,091	625,823.77	0.14
224	002624	完美世界	50,000	621,000.00	0.14
225	600637	东方明珠	74,300	617,433.00	0.14
226	001696	宗申动力	29,500	613,895.00	0.14
227	300699	光威复材	21,360	611,964.00	0.14
228	688188	柏楚电子	5,733	611,711.10	0.14
229	603225	新凤鸣	31,000	609,150.00	0.14
230	000750	国海证券	164,880	606,758.40	0.13
231	000983	山西焦煤	104,600	606,680.00	0.13
232	002085	万丰奥威	54,700	606,623.00	0.13
233	300558	贝达药业	9,300	605,151.00	0.13
234	002318	久立特材	25,300	604,670.00	0.13
235	603345	安井食品	7,500	601,425.00	0.13
236	002739	儒意电影	62,200	597,120.00	0.13
237	600369	西南证券	147,000	590,940.00	0.13
238	002065	东华软件	82,700	590,478.00	0.13
239	600100	同方股份	86,200	590,470.00	0.13
240	600499	科达制造	42,500	586,500.00	0.13
241	600536	中国软件	20,851	586,330.12	0.13

242	002266	浙富控股	115,457	584,212.42	0.13
243	603699	纽威股份	11,600	583,480.00	0.13
244	300627	华测导航	20,540	583,336.00	0.13
245	600595	中孚实业	103,500	581,670.00	0.13
246	002044	美年健康	115,200	579,456.00	0.13
247	603596	伯特利	23,260	577,778.40	0.13
248	603444	吉比特	1,600	573,472.00	0.13
249	688772	珠海冠宇	29,190	572,999.70	0.13
250	000400	许继电气	26,400	572,880.00	0.13
251	000155	川能动力	47,600	570,248.00	0.13
252	000629	钒钛股份	170,600	569,804.00	0.13
253	002223	鱼跃医疗	22,100	567,086.00	0.13
254	300002	神州泰岳	72,500	566,225.00	0.13
255	688617	惠泰医疗	3,110	564,651.60	0.13
256	002430	杭氧股份	18,200	563,472.00	0.13
257	300003	乐普医疗	47,400	561,690.00	0.12
258	601016	节能风电	144,710	561,474.80	0.12
259	300487	蓝晓科技	9,500	559,075.00	0.12
260	000032	深桑达A	22,400	558,880.00	0.12
261	000415	渤海租赁	137,000	557,590.00	0.12
262	600521	华海药业	38,600	555,840.00	0.12
263	600985	淮北矿业	39,500	554,975.00	0.12
264	601216	君正集团	124,300	554,378.00	0.12
265	601212	白银有色	109,100	554,228.00	0.12
266	601997	贵阳银行	108,000	554,040.00	0.12
267	601717	中创智领	39,800	553,618.00	0.12
268	000683	博源化工	96,100	553,536.00	0.12
269	600862	中航高科	30,700	553,521.00	0.12
270	000039	中集集团	67,960	551,155.60	0.12
271	600863	华能蒙电	115,700	543,790.00	0.12
272	603766	隆鑫通用	45,500	542,815.00	0.12
273	600704	物产中大	114,300	539,496.00	0.12
274	601001	晋控煤业	31,000	539,090.00	0.12
275	002841	视源股份	15,500	535,215.00	0.12
276	000050	深天马A	53,800	533,158.00	0.12
277	601990	南京证券	81,100	532,827.00	0.12
278	600873	梅花生物	72,300	531,405.00	0.12
279	688538	和辉光电	203,498	529,094.80	0.12
280	600312	平高电气	29,900	528,034.00	0.12
281	603077	和邦生物	227,100	526,872.00	0.12
282	000729	燕京啤酒	52,000	526,760.00	0.12
283	000887	中鼎股份	29,200	522,388.00	0.12
284	603605	珀莱雅	8,700	521,304.00	0.12

285	600332	白云山	26,000	521,040.00	0.12
286	000967	盈峰环境	49,300	519,129.00	0.12
287	688297	中无人机	12,447	517,172.85	0.11
288	600765	中航重机	39,920	515,766.40	0.11
289	688615	合合信息	4,527	512,003.70	0.11
290	600153	建发股份	64,200	509,106.00	0.11
291	600166	福田汽车	174,800	508,668.00	0.11
292	600348	华阳股份	66,478	508,556.70	0.11
293	000830	鲁西化工	42,200	506,400.00	0.11
294	688692	达梦数据	2,041	498,595.89	0.11
295	002410	广联达	60,960	497,433.60	0.11
296	002939	长城证券	59,400	495,396.00	0.11
297	002683	广东宏大	16,900	495,001.00	0.11
298	601611	中国核建	44,290	493,833.50	0.11
299	000062	深圳华强	15,500	493,210.00	0.11
300	600901	江苏金租	85,600	492,200.00	0.11
301	002007	华兰生物	40,200	490,038.00	0.11
302	600737	中粮糖业	39,538	487,503.54	0.11
303	600578	京能电力	73,900	476,655.00	0.11
304	688582	芯动联科	7,322	475,930.00	0.11
305	600363	联创光电	13,200	472,296.00	0.10
306	002926	华西证券	57,753	471,842.01	0.10
307	601799	星宇股份	5,200	471,224.00	0.10
308	000921	海信家电	17,200	469,904.00	0.10
309	603728	鸣志电器	7,700	469,084.00	0.10
310	603568	伟明环保	30,271	465,567.98	0.10
311	000591	太阳能	101,000	464,600.00	0.10
312	000737	北方铜业	35,100	464,022.00	0.10
313	600398	海澜之家	88,400	462,332.00	0.10
314	688114	华大智造	9,037	461,609.96	0.10
315	002603	以岭药业	30,700	460,500.00	0.10
316	603298	杭叉集团	19,300	460,498.00	0.10
317	601000	唐山港	109,600	454,840.00	0.10
318	600486	扬农化工	8,960	454,272.00	0.10
319	000528	柳工	60,100	453,755.00	0.10
320	600208	衢州发展	157,300	445,159.00	0.10
321	603341	龙旗科技	10,400	441,896.00	0.10
322	600316	洪都航空	15,800	441,452.00	0.10
323	000738	航发控制	24,100	440,789.00	0.10
324	600008	首创环保	162,030	440,721.60	0.10
325	000932	华菱钢铁	126,500	438,955.00	0.10
326	600995	南网储能	35,500	436,650.00	0.10
327	600998	九州通	92,907	435,733.83	0.10

328	600435	北方导航	38,900	435,680.00	0.10
329	600170	上海建工	196,100	435,342.00	0.10
330	000987	越秀资本	55,405	433,267.10	0.10
331	603486	科沃斯	8,500	431,375.00	0.10
332	002152	广电运通	45,800	429,604.00	0.10
333	000997	新 大 陆	26,300	428,690.00	0.10
334	600820	隧道股份	81,400	424,094.00	0.09
335	002262	恩华药业	22,600	423,750.00	0.09
336	688248	南网科技	6,102	422,136.36	0.09
337	000951	中国重汽	21,600	421,416.00	0.09
338	600161	天坛生物	36,300	420,354.00	0.09
339	600282	南钢股份	91,100	418,149.00	0.09
340	601106	中国一重	126,700	418,110.00	0.09
341	600483	福能股份	40,820	415,955.80	0.09
342	000009	中国宝安	66,700	415,541.00	0.09
343	603885	吉祥航空	40,100	412,629.00	0.09
344	600583	海油工程	81,500	409,945.00	0.09
345	603816	顾家家居	18,300	409,188.00	0.09
346	002500	山西证券	79,000	407,640.00	0.09
347	603939	益丰药房	22,412	402,967.76	0.09
348	600546	山煤国际	36,700	401,131.00	0.09
349	688778	厦钨新能	7,345	399,568.00	0.09
350	600329	达仁堂	10,682	397,584.04	0.09
351	000582	北部湾港	37,000	397,010.00	0.09
352	600763	通策医疗	11,705	396,565.40	0.09
353	603338	浙江鼎力	9,300	395,250.00	0.09
354	688295	中复神鹰	6,468	391,572.72	0.09
355	688318	财富趋势	5,483	390,992.73	0.09
356	601666	平煤股份	54,600	390,390.00	0.09
357	688166	博瑞医药	11,061	387,245.61	0.09
358	600562	国睿科技	18,200	386,204.00	0.09
359	601567	三星电气	25,800	385,452.00	0.09
360	600602	云赛智联	23,900	384,312.00	0.09
361	600685	中船防务	15,100	384,144.00	0.09
362	002312	川发龙蟒	41,800	383,306.00	0.09
363	600380	健康元	40,645	382,875.90	0.08
364	003022	联泓新科	14,700	380,730.00	0.08
365	603565	中谷物流	38,800	380,628.00	0.08
366	000723	美锦能源	113,500	380,225.00	0.08
367	600038	中直股份	15,000	379,350.00	0.08
368	300676	华大基因	10,800	378,648.00	0.08
369	600390	五矿资本	82,800	377,568.00	0.08
370	000513	丽珠集团	13,019	376,118.91	0.08

371	601880	辽港股份	272,500	376,050.00	0.08
372	601156	东航物流	23,300	375,596.00	0.08
373	601399	国机重装	106,300	372,050.00	0.08
374	600132	重庆啤酒	8,900	367,570.00	0.08
375	601865	福莱特	34,900	366,799.00	0.08
376	600511	国药股份	14,000	364,560.00	0.08
377	600535	天士力	27,500	363,825.00	0.08
378	000739	普洛药业	21,485	357,940.10	0.08
379	601236	红塔证券	52,200	356,004.00	0.08
380	600906	财达证券	47,500	354,350.00	0.08
381	600977	中国电影	27,400	354,008.00	0.08
382	600816	建元信托	144,700	353,068.00	0.08
383	300100	双林股份	12,700	352,806.00	0.08
384	000598	兴蓉环境	54,700	351,174.00	0.08
385	002244	滨江集团	46,000	349,600.00	0.08
386	600970	中材国际	48,500	345,805.00	0.08
387	688281	华秦科技	6,883	345,733.09	0.08
388	002299	圣农发展	22,800	345,648.00	0.08
389	601155	新城控股	33,500	343,710.00	0.08
390	002120	韵达股份	53,600	340,896.00	0.08
391	688336	三生国健	6,406	340,158.60	0.08
392	300146	汤臣倍健	37,600	339,904.00	0.08
393	300144	宋城演艺	58,300	338,723.00	0.08
394	600967	内蒙一机	31,200	338,520.00	0.08
395	000883	湖北能源	78,200	337,824.00	0.07
396	300735	光弘科技	14,800	336,552.00	0.07
397	300718	长盛轴承	5,500	335,335.00	0.07
398	002568	百润股份	19,400	328,248.00	0.07
399	688363	华熙生物	9,133	326,687.41	0.07
400	000027	深圳能源	52,440	325,128.00	0.07
401	000800	一汽解放	54,600	324,870.00	0.07
402	600131	国网信通	22,000	321,200.00	0.07
403	601608	中信重工	67,200	320,544.00	0.07
404	688278	特宝生物	5,881	319,926.40	0.07
405	600095	湘财股份	42,300	318,519.00	0.07
406	601866	中远海发	143,900	318,019.00	0.07
407	003021	兆威机电	3,600	314,460.00	0.07
408	000088	盐 田 港	76,700	313,703.00	0.07
409	603737	三棵树	12,958	312,287.80	0.07
410	601118	海南橡胶	63,200	310,944.00	0.07
411	002583	海能达	40,400	310,676.00	0.07
412	600801	华新建材	19,872	310,003.20	0.07
413	600126	杭钢股份	49,900	305,887.00	0.07

414	600871	石化油服	150,100	304,703.00	0.07
415	600754	锦江酒店	16,900	304,031.00	0.07
416	600566	济川药业	13,700	304,003.00	0.07
417	603000	人民网	20,500	303,195.00	0.07
418	002984	森麒麟	22,900	299,303.00	0.07
419	600517	国网英大	63,400	296,712.00	0.07
420	600655	豫园股份	71,800	295,098.00	0.07
421	000709	河钢股份	151,600	294,104.00	0.07
422	603589	口子窖	15,600	291,408.00	0.06
423	000825	太钢不锈	83,800	285,758.00	0.06
424	688192	迪哲医药	7,123	284,421.39	0.06
425	601598	中国外运	57,300	284,208.00	0.06
426	603858	步长制药	19,400	283,240.00	0.06
427	600598	北大荒	26,100	282,924.00	0.06
428	002423	中粮资本	34,100	280,643.00	0.06
429	001286	陕西能源	27,500	278,850.00	0.06
430	603899	晨光股份	13,500	278,505.00	0.06
431	600350	山东高速	25,000	278,250.00	0.06
432	600004	白云机场	38,100	276,606.00	0.06
433	601966	玲珑轮胎	27,100	276,149.00	0.06
434	002773	康弘药业	13,500	276,075.00	0.06
435	301606	绿联科技	4,500	274,590.00	0.06
436	600663	陆家嘴	43,300	271,924.00	0.06
437	600582	天地科技	60,800	270,560.00	0.06
438	688349	三一重能	17,593	267,061.74	0.06
439	600848	上海临港	35,400	265,146.00	0.06
440	000429	粤高速A	19,400	264,810.00	0.06
441	688709	成都华微	6,949	264,687.41	0.06
442	601098	中南传媒	26,600	261,744.00	0.06
443	002508	老板电器	17,500	255,850.00	0.06
444	603233	大参林	16,740	251,602.20	0.06
445	600968	海油发展	74,900	249,417.00	0.06
446	688563	航材股份	4,847	248,311.81	0.06
447	601928	凤凰传媒	28,000	246,120.00	0.05
448	300957	贝泰妮	7,800	245,778.00	0.05
449	003035	南网能源	42,000	244,440.00	0.05
450	600062	华润双鹤	15,200	243,808.00	0.05
451	688561	奇安信	10,015	240,159.70	0.05
452	688425	铁建重工	59,378	238,699.56	0.05
453	300888	稳健医疗	8,520	238,474.80	0.05
454	002032	苏 泊 尔	6,000	237,600.00	0.05
455	600688	上海石化	81,000	237,330.00	0.05
456	002670	国盛证券	21,500	236,500.00	0.05

457	601808	中海油服	21,800	235,658.00	0.05
458	600295	鄂尔多斯	21,900	234,768.00	0.05
459	600098	广州发展	38,500	227,535.00	0.05
460	688708	佳驰科技	4,397	223,367.60	0.05
461	000537	绿发电力	30,400	222,224.00	0.05
462	000539	粤电力A	32,600	222,006.00	0.05
463	600808	马钢股份	88,400	221,000.00	0.05
464	002153	石基信息	29,904	216,205.92	0.05
465	600292	电投水电	17,800	214,312.00	0.05
466	600377	宁沪高速	18,200	210,574.00	0.05
467	601298	青岛港	25,900	208,495.00	0.05
468	002265	建设工业	11,600	201,840.00	0.04
469	603833	欧派家居	6,700	201,737.00	0.04
470	000959	首钢股份	57,100	200,421.00	0.04
471	301301	川宁生物	24,700	196,118.00	0.04
472	002608	江苏国信	27,900	192,510.00	0.04
473	603529	爱玛科技	9,800	191,198.00	0.04
474	600339	中油工程	62,100	190,647.00	0.04
475	600032	浙江新能	26,600	187,530.00	0.04
476	600606	绿地控股	154,300	186,703.00	0.04
477	600764	中国海防	10,600	184,758.00	0.04
478	000785	居然智家	91,800	183,600.00	0.04
479	603658	安图生物	6,300	182,826.00	0.04
480	603786	科博达	4,400	180,004.00	0.04
481	601139	深圳燃气	31,600	178,856.00	0.04
482	301498	乖宝宠物	4,300	174,537.00	0.04
483	688520	神州细胞	5,040	172,418.40	0.04
484	000937	冀中能源	42,730	170,065.40	0.04
485	300140	节能环境	34,100	169,477.00	0.04
486	000898	鞍钢股份	88,800	166,056.00	0.04
487	603049	中策橡胶	3,700	165,797.00	0.04
488	603175	超颖电子	1,800	160,362.00	0.04
489	601228	广州港	55,800	157,356.00	0.03
490	688475	萤石网络	5,716	156,332.60	0.03
491	601019	山东出版	23,300	149,120.00	0.03
492	600927	永安期货	10,900	135,705.00	0.03
493	002945	华林证券	10,100	135,643.00	0.03
494	601112	振石股份	6,964	126,720.76	0.03
495	002461	珠江啤酒	16,400	124,148.00	0.03
496	600299	安迪苏	14,800	116,180.00	0.03
497	688819	天能股份	4,993	110,844.60	0.02
498	603092	德力佳	1,300	70,161.00	0.02
499	001221	悍高集团	1,500	60,330.00	0.01

500	001386	马可波罗	3,900	55,224.00	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	688783	西安奕材	15,900	912,978.00	0.20
2	688802	沐曦股份	965	741,978.85	0.16
3	301666	大普微	697	322,941.01	0.07
4	688765	禾元生物	6,361	308,890.16	0.07
5	688759	必贝特	8,107	248,479.55	0.06
6	001248	华润新能源	18,895	191,028.45	0.04
7	688808	联讯仪器	114	180,613.62	0.04
8	688781	视涯科技	4,277	180,318.32	0.04
9	688790	昂瑞微	1,043	131,887.35	0.03
10	688820	盛合晶微	663	93,807.87	0.02
11	688818	电科蓝天	1,153	80,871.42	0.02
12	688797	臻宝科技	166	77,799.22	0.02
13	301682	宏明电子	431	68,985.86	0.02
14	001399	惠科股份	2,186	60,617.78	0.01
15	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
16	688785	恒运昌	98	45,388.70	0.01
17	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
18	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
19	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
20	603459	红板科技	291	24,537.12	0.01
21	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
22	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
23	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
24	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
25	001365	天海电子	480	15,028.80	0.00
26	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
27	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
28	001393	维通利	338	13,178.62	0.00
29	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
30	001237	惠康科技	194	11,395.56	0.00
31	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
32	688816	易思维	159	9,078.90	0.00
33	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
34	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
35	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
38	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

39	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
40	400174	中天3	202,200	0.00	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	688498	源杰科技	5,382,516.40	1.43
2	001309	德明利	3,753,553.00	1.00
3	300666	江丰电子	2,305,039.00	0.61
4	600105	永鼎股份	2,299,826.00	0.61
5	300475	香农芯创	2,279,129.00	0.60
6	300548	长芯博创	2,090,806.00	0.55
7	601869	长飞光纤	1,985,432.00	0.53
8	688313	仕佳光子	1,830,673.94	0.49
9	300620	光库科技	1,702,941.00	0.45
10	002407	多氟多	1,669,657.80	0.44
11	688200	华峰测控	1,655,080.85	0.44
12	603256	宏和科技	1,454,272.00	0.39
13	301377	鼎泰高科	1,449,877.00	0.38
14	600711	盛屯矿业	1,440,580.00	0.38
15	002812	恩捷股份	1,399,725.00	0.37
16	688037	芯源微	1,312,269.67	0.35
17	301526	国际复材	1,244,016.00	0.33
18	603308	应流股份	1,063,011.00	0.28
19	600256	广汇能源	1,039,740.00	0.28
20	688411	海博思创	1,029,512.47	0.27

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	600487	亨通光电	7,272,472.00	1.93
2	002353	杰瑞股份	4,095,683.00	1.09
3	301308	江波龙	4,082,244.00	1.08
4	688525	佰维存储	4,049,185.27	1.07
5	002156	通富微电	3,165,385.00	0.84
6	000657	中钨高新	3,078,067.00	0.82
7	600549	厦门钨业	2,793,515.00	0.74
8	002837	英维克	2,429,706.00	0.64
9	000426	兴业银锡	2,398,075.00	0.64

10	002202	金风科技	2,323,018.00	0.62
11	300450	先导智能	2,130,961.00	0.57
12	002080	中材科技	1,904,701.00	0.51
13	601168	西部矿业	1,902,478.00	0.50
14	000933	神火股份	1,897,410.00	0.50
15	600673	东阳光	1,822,616.00	0.48
16	600118	中国卫星	1,714,679.00	0.45
17	002532	天山铝业	1,702,128.00	0.45
18	002558	巨人网络	1,497,009.00	0.40
19	002128	电投能源	1,470,954.00	0.39
20	600580	卧龙电驱	1,412,160.32	0.37

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	112,074,984.99
卖出股票收入（成交）总额	114,790,383.92

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本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	3,372,431.19
2	应收清算款	74,279.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,446,710.29

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

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	占基金资产净	流通受限情况说

			允价值	值比例（%）	明
1	688783	西安奕材	912,978.00	0.20	新股锁定
2	688802	沐曦股份	741,978.85	0.16	新股锁定
3	301666	大普微	322,941.01	0.07	新股锁定
4	688765	禾元生物	308,890.16	0.07	新股锁定
5	688759	必贝特	248,479.55	0.06	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（%）
452	99,511.90	43,592,511.00	96.92	1,386,868.00	3.08

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国银行股份有限公司-工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	13,139,300.00	29.21

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年10月17日）基金份额总额	1,080,968,281.00
本报告期期初基金份额总额	46,479,379.00
本报告期基金总申购份额	7,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,979,379.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人

自2026年3月9日起，梅迎春女士担任公司副总经理。

2、基金托管人

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	137,447,897.95	61.15	18,681.70	61.15	-
中信证券	2	71,478,262.44	31.80	9,714.55	31.80	-
华泰证券	4	15,055,026.01	6.70	2,046.54	6.70	-
申万宏源	2	776,018.48	0.35	105.48	0.35	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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,基金管理人对证券公司进行考察、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。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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浦领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	2026年1月9日
2	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	2026年3月11日
3	工银瑞信基金管理有限公司旗下公募	中国证监会规定的媒介	2026年3月31日

	基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况		
4	工银瑞信基金管理有限公司关于终止上海凯石财富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	2026年4月10日
5	2025年度工银瑞信基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定的媒介	2026年4月30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	20260101-20260630	28,282,724.00	-	-	28,282,724.00	62.88
个人	-	-	-	-	-	-	-
中国银行股份有限公司-工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20260101-20260630	14,644,200.00	7,132,400.00	8,637,300.00	13,139,300.00	29.21
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中，存在基金规模大幅波动的风险，以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

注：1、期初份额为上期期末或基金合同公告生效日当天份额。

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbcubs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2026年8月31日