工银瑞信沪深 300 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 43

7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55
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 55

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 55
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 55
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 55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
7.12 投资组合报告附注 55

§8 基金份额持有人信息 57

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 57
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 57

§9 开放式基金份额变动 57

§10 重大事件揭示 58

10.1 基金份额持有人大会决议 58
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 58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 58
10.4 基金投资策略的改变 58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 58
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 58
10.8 其他重大事件 60

§11 影响投资者决策的其他重要信息 61

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 61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 61

§12 备查文件目录 62

12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪深 300ETF 工银
场内简称	工银 300、沪深 300ETF 工银
基金主代码	510350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 20 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	679,614,701.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 8 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031

法定代表人	赵桂才	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告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	255,865,972.66
本期利润	310,176,371.38
加权平均基金份额本期利润	0.4345
本期加权平均净值利润率	8.76%
本期基金份额净值增长率	8.81%
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	813,053,642.12
期末可供分配基金份额利润	1.1963
期末基金资产净值	3,568,928,038.93
期末基金份额净值	5.2514
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	50.82%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①－③	②－④

		②		准差④		
过去三个月	13.06%	1.25%	11.90%	1.26%	1.16%	-0.01%
过去六个月	8.81%	1.13%	7.55%	1.13%	1.26%	0.00%
过去一年	30.24%	1.02%	26.51%	1.02%	3.73%	0.00%
过去三年	40.80%	1.11%	29.59%	1.11%	11.21%	0.00%
过去五年	8.64%	1.11%	-4.68%	1.12%	13.32%	-0.01%
过去七年	49.49%	1.15%	30.16%	1.17%	19.33%	-0.02%
自基金合同生效起至今	50.82%	1.15%	36.47%	1.16%	14.35%	-0.01%

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



注：1、本基金基金合同于 2019 年 5 月 20 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

工银瑞信基金管理有限公司是中国工商银行控股的基金管理公司，成立于 2005 年 6 月。目前，公司在北京、上海、深圳等地设有分公司，分别在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

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

公司秉持“以人为本”的理念，全方位引入国内外优秀人才，组建了一支风格稳健、诚信敬业、创新进取、团结协作的专业团队。目前，公司（含子公司）共有员工 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		
刘伟琳	指数及量化投资部投资总	2019 年 5 月 20 日	-	15 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

	监、本基金的基金经理				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 2026 年 2 月 9 日，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 2026 年 2 月 5 日，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 2026 年 4 月 9 日，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；2026 年 2 月 5 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发起式联接基金基金经理；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。

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 8.81%，业绩比较基准收益率为 7.55%。

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。

沪深 300 指数是中国 A 股市场上市值大、流动性好的 300 只股票构成的指数，是 A 股市场上影响力最大、最典型的龙头代表指数，其长期表现深度受益于中国经济的稳健增长和产业升级的

持续优化。根据海外发达资本市场经验，A 股市场机构化程度会日益提高，而出于市场容量及研究深度的考虑，龙头股票是机构更加青睐的板块；从相对估值看，沪深 300 指数的股债性价比处于最近十年 50%左右的位置，相对于债券未来预期收益仍然具有一定优势；对比 A 股市场龙头板块与全市场股票的业绩，A 股龙头板块业绩相对较好。因此从机构偏好程度、相对估值与业绩三个角度考虑，代表 A 股龙头板块的沪深 300 指数是我们未来长期看好的指数之一。

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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：工银瑞信沪深 300 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	68,991,949.77	47,763,401.59
结算备付金		14,950,863.06	36,922,541.64

存出保证金		8,866,450.42	8,294,640.56
交易性金融资产	6.4.7.2	3,480,461,644.51	3,981,662,475.34
其中：股票投资		3,480,461,644.51	3,981,662,475.34
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		1,719,604.93	16,743,365.76
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		3,574,990,512.69	4,091,386,424.89
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		434,218.88	470,367.74
应付托管费		144,739.62	156,789.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		222,400.03	304,719.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,261,115.23	15,486,754.86
负债合计		6,062,473.76	16,418,631.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,591,314,612.14	3,219,302,081.88
未分配利润	6.4.7.12	977,613,426.79	855,665,711.79
净资产合计		3,568,928,038.93	4,074,967,793.67
负债和净资产总计		3,574,990,512.69	4,091,386,424.89

注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 20 日。

2、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 5.2514 元，基金份额总额为 679,614,701.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		313,801,710.77	69,857,678.06
1.利息收入		281,559.22	273,842.67
其中：存款利息收入	6.4.7.13	281,559.22	273,842.67
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）		259,158,746.26	115,537,508.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	217,859,208.60	63,808,967.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	263.27
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	6,615,758.77	-630,427.80
股利收益	6.4.7.19	34,683,778.89	52,358,704.80
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	54,310,398.72	-47,709,162.59
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	51,006.57	1,755,489.75
减：二、营业总支出		3,625,339.39	4,826,101.71
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,629,478.01	3,293,713.99
2．托管费	6.4.10.2.2	876,492.69	1,097,904.62
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		23,828.57	0.94

8. 其他费用	6.4.7.23	95,540.12	434,482.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		310,176,371.38	65,031,576.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		310,176,371.38	65,031,576.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		310,176,371.38	65,031,576.35

6.3 净资产变动表

会计主体：工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	3,219,302,081.88	855,665,711.79	4,074,967,793.67
二、本期期初净资产	3,219,302,081.88	855,665,711.79	4,074,967,793.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-627,987,469.74	121,947,715.00	-506,039,754.74
（一）、综合收益总额	-	310,176,371.38	310,176,371.38
（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）	-627,987,469.74	-188,228,656.38	-816,216,126.12
其中：1.基金申购款	315,709,547.73	91,275,972.18	406,985,519.91
2.基金赎回款	-943,697,017.47	-279,504,628.56	-1,223,201,646.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,591,314,612.14	977,613,426.79	3,568,928,038.93
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	4,688,037,803.34	203,680,508.48	4,891,718,311.82
二、本期期初净资产	4,688,037,803.34	203,680,508.48	4,891,718,311.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,300,586,071.17	-8,997,177.36	-1,309,583,248.53
（一）、综合收益总额	-	65,031,576.35	65,031,576.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,300,586,071.17	-74,028,753.71	-1,374,614,824.88
其中：1.基金申购款	902,517,511.46	11,266,071.29	913,783,582.75
2.基金赎回款	-2,203,103,582.63	-85,294,825.00	-2,288,398,407.63
（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	3,387,451,732.17	194,683,331.12	3,582,135,063.29

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

工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2139 号文，由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指

数证券投资基金基金合同》于 2019 年 05 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,863,688,383.00 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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	68,991,949.77
等于：本金	68,986,075.06
加：应计利息	5,874.71
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	68,991,949.77

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		2,793,887,925.20	-	3,480,461,644.51	686,573,719.31
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		2,793,887,925.20	-	3,480,461,644.51	686,573,719.31

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	70,034,100.00	-	-	-
其中：股指期货投资	70,034,100.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	70,034,100.00	-	-	-

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
IF2612	IF2612	49.00	69,992,580.00	-41,520.00
合计				-41,520.00
减：可抵销期货暂收款				-41,520.00
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	73,725.47
其中：交易所市场	73,725.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	13,388.57
预提信息披露费	59,507.37
应退替代款	4,676,479.91
可退替代款	428,096.92
IOPV 服务费	9,916.99

合计	5,261,115.23

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	844,314,701.00	3,219,302,081.88
本期申购	82,800,000.00	315,709,547.73
本期赎回（以“-”号填列）	-247,500,000.00	-943,697,017.47
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	679,614,701.00	2,591,314,612.14

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	716,087,047.54	139,578,664.25	855,665,711.79
本期期初	716,087,047.54	139,578,664.25	855,665,711.79
本期利润	255,865,972.66	54,310,398.72	310,176,371.38
本期基金份额交易产生的变动数	-158,899,378.08	-29,329,278.30	-188,228,656.38
其中：基金申购款	85,623,704.52	5,652,267.66	91,275,972.18
基金赎回款	-244,523,082.60	-34,981,545.96	-279,504,628.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	813,053,642.12	164,559,784.67	977,613,426.79

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	63,432.20
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	217,255.51
其他	871.51

合计	281,559.22

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	111,799,774.80
股票投资收益——赎回差价收入	106,059,433.80
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	217,859,208.60

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	672,323,480.91
减：卖出股票成本总额	559,975,210.46
减：交易费用	548,495.65
买卖股票差价收入	111,799,774.80

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	1,223,201,646.03
减：现金支付赎回款总额	490,995,193.03
减：赎回股票成本总额	626,147,019.20
减：交易费用	-
赎回差价收入	106,059,433.80

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	6,615,758.77

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	34,683,778.89
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	34,683,778.89

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	55,402,098.72
股票投资	55,402,098.72
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	-1,091,700.00
权证投资	-
期货投资	-1,091,700.00
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	54,310,398.72

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	51,006.57
合计	51,006.57

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	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	12,727.19
IOPV 服务费	9,916.99
合计	95,540.12

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
瑞士银行有限公司（UBS AG）	基金管理人股东
工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	2,629,478.01	3,293,713.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,002.15	39,890.02
应支付基金管理人的净管理费	2,597,475.86	3,253,823.97

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

H＝E×0.15%÷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 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	876,492.69	1,097,904.62

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

H＝E×0.05%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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（%）
瑞士银行有限公司（UBS AG）	24.00	0.00	27,324.00	0.00
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	28,169,300.00	4.14	31,677,100.00	3.75

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
中国农业银行股份有限公司	68,991,949.77	63,432.20	49,392,986.25	55,961.68

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 3,520,100.00 股农业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 21,367,007.00 元，占基金资产净值的比例为 0.6%；本基金持有 3,970,500.00 股工商银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 28,071,435.00 元，占基金资产净值的比例为 0.79%。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 4,525,600.00 股农业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 34,756,608.00 元，占基金资产净值的比例为 0.85%；本基金持有 5,091,300.00 股工商银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 40,374,009.00 元，占基金资产净值的比例为 0.99%。

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
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-

688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股锁定	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股锁定	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	9 个月	新股锁定	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
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	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科	2026 年 6	6 个月	新股	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

	股份	月 16 日		锁定						
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
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	116	10,692.88	53,725.40	-
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	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
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	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
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	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
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	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
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	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕	2026 年 4	6 个月	新股	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-

	集团	月 29 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	-
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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	24,535	16,031,768.27	20,413,120.00	-

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	68,991,949.77	-	-	-	68,991,949.77
结算备付金	14,950,863.06	-	-	-	14,950,863.06
存出保证金	8,866,450.42	-	-	-	8,866,450.42
交易性金融资产	-	-	-	3,480,461,644.51	3,480,461,644.51

应收清算款	-	-	-	1,719,604.93	1,719,604.93
资产总计	92,809,263.25	-	-	3,482,181,249.44	3,574,990,512.69
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	434,218.88	434,218.88
应付托管费	-	-	-	144,739.62	144,739.62
应交税费	-	-	-	222,400.03	222,400.03
其他负债	-	-	-	5,261,115.23	5,261,115.23
负债总计	-	-	-	6,062,473.76	6,062,473.76
利率敏感度缺口	92,809,263.25	-	-	3,476,118,775.68	3,568,928,038.93
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	47,763,401.59	-	-	-	47,763,401.59
结算备付金	36,922,541.64	-	-	-	36,922,541.64
存出保证金	8,294,640.56	-	-	-	8,294,640.56
交易性金融资产	-	-	-	3,981,662,475.34	3,981,662,475.34
应收清算款	-	-	-	16,743,365.76	16,743,365.76
资产总计	92,980,583.79	-	-	3,998,405,841.10	4,091,386,424.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	470,367.74	470,367.74
应付托管费	-	-	-	156,789.24	156,789.24
应交税费	-	-	-	304,719.38	304,719.38
其他负债	-	-	-	15,486,754.86	15,486,754.86
负债总计	-	-	-	16,418,631.22	16,418,631.22
利率敏感度缺口	92,980,583.79	-	-	3,981,987,209.88	4,074,967,793.67

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	3,480,461,644.51	97.52	3,981,662,475.34	97.71
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	3,480,461,644.51	97.52	3,981,662,475.34	97.71

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%	177,773,679.84	203,651,127.08
	业绩比较基准减少	-177,773,679.84	-203,651,127.08

	5%		

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	3,442,359,061.25	3,945,892,507.72
第二层次	21,263,411.44	25,036,295.68
第三层次	16,839,171.82	10,733,671.94
合计	3,480,461,644.51	3,981,662,475.34

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	3,480,461,644.51	97.36
	其中：股票	3,480,461,644.51	97.36
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	83,942,812.83	2.35
8	其他各项资产	10,586,055.35	0.30
9	合计	3,574,990,512.69	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	19,741,080.65	0.55
B	采矿业	145,026,143.07	4.06
C	制造业	2,220,253,108.18	62.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,063,276.94	2.41

E	建筑业	39,487,160.40	1.11
F	批发和零售业	5,137,988.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	83,949,592.44	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	184,737,643.53	5.18
J	金融业	606,673,185.72	17.00
K	房地产业	11,288,760.89	0.32
L	租赁和商务服务业	15,823,770.04	0.44
M	科学研究和技术服务业	37,751,681.02	1.06
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	4,722,076.80	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,996,200.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	3,462,651,667.68	97.02

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	0.00
C	制造业	16,919,508.13	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.02
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	2,443.98	0.00
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	17,809,976.83	0.50

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	300308	中际旭创	136,520	173,380,400.00	4.86
2	300750	宁德时代	324,451	127,512,487.51	3.57
3	300502	新易盛	171,148	103,886,836.00	2.91
4	600519	贵州茅台	76,560	90,761,114.40	2.54
5	603986	兆易创新	81,852	66,709,380.00	1.87
6	601318	中国平安	1,305,645	62,331,492.30	1.75
7	688256	寒武纪	37,684	60,126,706.20	1.68
8	600036	招商银行	1,512,241	53,684,555.50	1.50
9	601899	紫金矿业	2,018,827	50,753,310.78	1.42
10	002371	北方华创	52,797	46,702,114.32	1.31
11	000333	美的集团	595,883	45,007,042.99	1.26
12	002475	立讯精密	624,198	43,943,539.20	1.23
13	688008	澜起科技	140,378	43,503,142.20	1.22
14	688012	中微公司	91,805	43,010,642.50	1.21
15	688041	海光信息	113,514	42,034,234.20	1.18
16	002384	东山精密	157,300	41,267,655.00	1.16
17	600900	长江电力	1,498,813	39,673,580.11	1.11
18	688981	中芯国际	245,385	38,972,045.70	1.09
19	000725	京东方 A	4,454,600	38,665,928.00	1.08
20	603259	药明康德	303,202	37,751,681.02	1.06
21	601138	工业富联	485,999	35,064,827.85	0.98

22	600030	中信证券	1,196,246	34,368,147.58	0.96
23	601166	兴业银行	2,074,150	34,347,924.00	0.96
24	300059	东方财富	1,551,175	31,612,946.50	0.89
25	600183	生益科技	178,866	31,015,364.40	0.87
26	600276	恒瑞医药	547,683	28,501,423.32	0.80
27	300274	阳光电源	178,220	28,340,544.40	0.79
28	601398	工商银行	3,970,500	28,071,435.00	0.79
29	300408	三环集团	164,608	27,473,075.20	0.77
30	002594	比亚迪	332,281	26,482,795.70	0.74
31	300476	胜宏科技	74,850	25,930,285.50	0.73
32	002463	沪电股份	165,300	25,257,840.00	0.71
33	601211	国泰海通	1,383,181	25,173,894.20	0.71
34	300394	天孚通信	80,256	24,291,886.08	0.68
35	000988	华工科技	123,000	22,707,030.00	0.64
36	301308	江波龙	31,500	22,169,700.00	0.62
37	600176	中国巨石	294,466	21,460,682.08	0.60
38	601288	农业银行	3,520,100	21,367,007.00	0.60
39	601328	交通银行	3,271,100	21,033,173.00	0.59
40	000651	格力电器	549,597	20,609,887.50	0.58
41	688072	拓荆科技	24,535	20,413,120.00	0.57
42	600522	中天科技	334,300	20,285,324.00	0.57
43	600919	江苏银行	1,797,420	19,376,187.60	0.54
44	603019	中科曙光	179,627	19,261,403.21	0.54
45	688521	芯原股份	51,053	18,947,810.42	0.53
46	603993	洛阳钼业	1,071,500	18,804,825.00	0.53
47	600150	中国船舶	552,971	18,684,890.09	0.52
48	600887	伊利股份	775,018	18,569,431.28	0.52
49	600584	长电科技	175,700	18,193,735.00	0.51
50	000338	潍柴动力	658,993	17,957,559.25	0.50
51	000858	五 粮 液	237,828	17,599,272.00	0.49
52	601816	京沪高铁	3,598,600	16,301,658.00	0.46
53	600309	万华化学	230,221	15,749,418.61	0.44
54	002916	深南电路	33,739	15,449,088.10	0.43
55	300124	汇川技术	232,382	15,413,898.06	0.43
56	002415	海康威视	448,885	15,351,867.00	0.43
57	600111	北方稀土	310,400	14,914,720.00	0.42
58	000100	TCL 科技	2,541,260	14,790,133.20	0.41
59	601688	华泰证券	716,798	14,780,374.76	0.41
60	000063	中兴通讯	395,349	14,307,680.31	0.40
61	600000	浦发银行	1,632,067	14,052,096.87	0.39
62	600089	特变电工	619,270	13,933,575.00	0.39
63	601857	中国石油	1,585,269	13,760,134.92	0.39
64	002028	思源电气	76,300	13,199,900.00	0.37

65	601088	中国神华	336,100	13,121,344.00	0.37
66	300433	蓝思科技	244,499	13,119,816.34	0.37
67	600031	三一重工	726,972	12,562,076.16	0.35
68	300014	亿纬锂能	186,015	12,096,555.45	0.34
69	002050	三花智控	274,249	12,020,333.67	0.34
70	002142	宁波银行	404,494	12,009,426.86	0.34
71	601601	中国太保	419,344	11,959,690.88	0.34
72	000001	平安银行	1,187,800	11,937,390.00	0.33
73	000792	盐湖股份	389,100	11,746,929.00	0.33
74	002714	牧原股份	334,307	11,697,401.93	0.33
75	002353	杰瑞股份	75,400	11,498,500.00	0.32
76	600406	国电南瑞	491,505	11,230,889.25	0.31
77	601668	中国建筑	2,528,540	10,973,863.60	0.31
78	600549	厦门钨业	127,000	10,820,400.00	0.30
79	000657	中钨高新	111,200	10,644,064.00	0.30
80	601229	上海银行	1,219,263	10,583,202.84	0.30
81	601919	中远海控	768,490	10,190,177.40	0.29
82	002602	世纪华通	721,900	10,178,790.00	0.29
83	300760	迈瑞医疗	74,300	10,092,169.00	0.28
84	601988	中国银行	1,754,100	10,033,452.00	0.28
85	601939	建设银行	1,038,400	9,999,792.00	0.28
86	603501	豪威集团	104,330	9,895,700.50	0.28
87	600660	福耀玻璃	195,787	9,875,496.28	0.28
88	601728	中国电信	1,901,100	9,866,709.00	0.28
89	600016	民生银行	3,036,800	9,778,496.00	0.27
90	601012	隆基绿能	742,725	9,744,552.00	0.27
91	601225	陕西煤业	476,000	9,686,600.00	0.27
92	002230	科大讯飞	235,629	9,623,088.36	0.27
93	600999	招商证券	453,310	9,564,841.00	0.27
94	600941	中国移动	110,100	9,482,913.00	0.27
95	600690	海尔智家	459,497	9,378,333.77	0.26
96	002352	顺丰控股	293,793	9,183,969.18	0.26
97	601985	中国核电	1,007,800	9,100,434.00	0.25
98	002460	赣锋锂业	138,280	9,043,512.00	0.25
99	002709	天赐材料	175,300	9,015,679.00	0.25
100	002938	鹏鼎控股	85,300	8,988,914.00	0.25
101	600926	杭州银行	621,221	8,976,643.45	0.25
102	603799	华友钴业	185,817	8,967,528.42	0.25
103	601169	北京银行	1,815,099	8,893,985.10	0.25
104	300033	同花顺	36,506	8,797,946.00	0.25
105	000977	浪潮信息	125,400	8,778,000.00	0.25
106	600160	巨化股份	165,300	8,762,553.00	0.25
107	000776	广发证券	361,000	8,447,400.00	0.24

108	300442	润泽科技	100,800	8,373,456.00	0.23
109	000425	徐工机械	1,005,600	8,135,304.00	0.23
110	688126	沪硅产业	202,525	8,078,722.25	0.23
111	000938	紫光股份	279,176	8,057,019.36	0.23
112	002202	金风科技	336,700	8,047,130.00	0.23
113	300498	温氏股份	652,896	8,043,678.72	0.23
114	601600	中国铝业	969,736	7,971,229.92	0.22
115	600028	中国石化	1,787,000	7,970,020.00	0.22
116	600938	中国海油	293,000	7,954,950.00	0.22
117	600460	士兰微	142,300	7,778,118.00	0.22
118	002600	领益智造	448,100	7,770,054.00	0.22
119	688082	盛美上海	17,934	7,747,488.00	0.22
120	002466	天齐锂业	126,300	7,744,716.00	0.22
121	601766	中国中车	1,489,056	7,743,091.20	0.22
122	600050	中国联通	1,918,200	7,672,800.00	0.21
123	300661	圣邦股份	53,086	7,616,779.28	0.21
124	601009	南京银行	757,200	7,488,708.00	0.21
125	002837	英维克	93,800	7,462,728.00	0.21
126	002049	紫光国微	83,420	7,403,525.00	0.21
127	002179	中航光电	156,076	7,210,711.20	0.20
128	601628	中国人寿	203,809	7,204,648.15	0.20
129	601100	恒立液压	65,556	7,051,203.36	0.20
130	000568	泸州老窖	90,253	6,996,412.56	0.20
131	601872	招商轮船	397,000	6,975,290.00	0.20
132	002241	歌尔股份	304,900	6,869,397.00	0.19
133	603288	海天味业	204,105	6,768,121.80	0.19
134	601006	大秦铁路	1,463,140	6,745,075.40	0.19
135	000408	藏格矿业	96,300	6,675,516.00	0.19
136	601658	邮储银行	1,352,200	6,666,346.00	0.19
137	605117	德业股份	62,210	6,605,457.80	0.19
138	601818	光大银行	2,272,200	6,566,658.00	0.18
139	600809	山西汾酒	59,698	6,529,170.26	0.18
140	600905	三峡能源	1,750,200	6,493,242.00	0.18
141	601888	中国中免	119,524	6,419,634.04	0.18
142	600489	中金黄金	355,500	6,416,775.00	0.18
143	002625	光启技术	211,400	6,409,648.00	0.18
144	688396	华润微	64,942	6,335,092.10	0.18
145	000630	铜陵有色	986,600	6,274,776.00	0.18
146	600893	航发动力	163,380	6,263,989.20	0.18
147	600010	包钢股份	2,767,300	6,171,079.00	0.17
148	601127	赛力斯	100,585	6,160,831.25	0.17
149	601336	新华保险	102,640	6,123,502.40	0.17
150	688271	联影医疗	60,336	6,107,813.28	0.17

151	688111	金山办公	28,662	6,106,439.10	0.17
152	600958	东方证券	640,028	6,041,864.32	0.17
153	601689	拓普集团	106,810	6,026,220.20	0.17
154	002027	分众传媒	1,240,200	6,002,568.00	0.17
155	600118	中国卫星	72,200	5,924,010.00	0.17
156	600019	宝钢股份	1,065,561	5,785,996.23	0.16
157	600760	中航沈飞	139,062	5,715,448.20	0.16
158	000807	云铝股份	256,000	5,667,840.00	0.16
159	600104	上汽集团	564,245	5,507,031.20	0.15
160	601838	成都银行	311,098	5,506,434.60	0.15
161	600362	江西铜业	126,900	5,494,770.00	0.15
162	600989	宝丰能源	269,800	5,485,034.00	0.15
163	300450	先导智能	134,000	5,456,480.00	0.15
164	601727	上海电气	773,900	5,417,300.00	0.15
165	600875	东方电气	186,900	5,377,113.00	0.15
166	688183	生益电子	40,290	5,334,396.00	0.15
167	002001	新 和 成	187,523	5,329,403.66	0.15
168	601825	沪农商行	708,000	5,302,920.00	0.15
169	002422	科伦药业	136,000	5,238,720.00	0.15
170	601390	中国中铁	1,256,100	5,237,937.00	0.15
171	000538	云南白药	109,720	5,197,436.40	0.15
172	601995	中金公司	143,400	5,183,910.00	0.15
173	603296	华勤技术	69,476	5,159,982.52	0.14
174	601377	兴业证券	846,176	5,110,903.04	0.14
175	600547	山东黄金	220,833	5,099,033.97	0.14
176	600795	国电电力	1,089,100	5,086,097.00	0.14
177	600015	华夏银行	780,431	4,986,954.09	0.14
178	600585	海螺水泥	293,401	4,973,146.95	0.14
179	601669	中国电建	1,057,662	4,971,011.40	0.14
180	603893	瑞芯微	26,000	4,897,360.00	0.14
181	000166	申万宏源	1,104,700	4,860,680.00	0.14
182	601916	浙商银行	1,845,200	4,852,876.00	0.14
183	300316	晶盛机电	80,300	4,850,120.00	0.14
184	002648	卫星化学	206,020	4,839,409.80	0.14
185	300015	爱尔眼科	571,680	4,722,076.80	0.13
186	601698	中国卫通	155,900	4,715,975.00	0.13
187	601066	中信建投	158,941	4,620,414.87	0.13
188	600346	恒力石化	258,480	4,577,680.80	0.13
189	601868	中国能建	1,708,000	4,560,360.00	0.13
190	600482	中国动力	138,800	4,552,640.00	0.13
191	601998	中信银行	651,000	4,511,430.00	0.13
192	002311	海大集团	100,800	4,496,688.00	0.13
193	002558	巨人网络	162,600	4,481,256.00	0.13

194	300418	昆仑万维	109,600	4,423,456.00	0.12
195	600066	宇通客车	162,800	4,364,668.00	0.12
196	000625	长安汽车	608,070	4,359,861.90	0.12
197	600426	华鲁恒升	181,900	4,351,048.00	0.12
198	002532	天山铝业	398,100	4,271,613.00	0.12
199	600221	海航控股	3,156,700	4,261,545.00	0.12
200	000157	中联重科	606,823	4,229,556.31	0.12
201	605499	东鹏饮料	33,561	4,142,434.23	0.12
202	688036	传音控股	70,037	4,128,681.15	0.12
203	600011	华能国际	540,756	4,104,338.04	0.12
204	300803	指南针	44,600	4,088,482.00	0.11
205	600048	保利发展	878,600	4,067,918.00	0.11
206	600438	通威股份	330,693	4,004,692.23	0.11
207	600436	片仔癀	36,600	3,999,648.00	0.11
208	002236	大华股份	240,900	3,972,441.00	0.11
209	601077	渝农商行	649,800	3,970,278.00	0.11
210	600115	中国东航	1,040,862	3,965,684.22	0.11
211	002493	荣盛石化	367,355	3,949,066.25	0.11
212	600886	国投电力	293,661	3,908,627.91	0.11
213	600570	恒生电子	184,397	3,907,372.43	0.11
214	600188	兖矿能源	219,550	3,901,403.50	0.11
215	688047	龙芯中科	24,780	3,832,722.60	0.11
216	003816	中国广核	962,500	3,763,375.00	0.11
217	002736	国信证券	374,900	3,745,251.00	0.10
218	601058	赛轮轮胎	323,300	3,727,649.00	0.10
219	601360	三六零	428,900	3,727,141.00	0.10
220	000301	东方盛虹	323,100	3,699,495.00	0.10
221	600026	中远海能	204,900	3,675,906.00	0.10
222	601901	方正证券	505,917	3,642,602.40	0.10
223	002074	国轩高科	132,000	3,631,320.00	0.10
224	600009	上海机场	151,926	3,509,490.60	0.10
225	600196	复星医药	155,692	3,498,399.24	0.10
226	000768	中航西飞	170,171	3,485,102.08	0.10
227	000975	山金国际	204,100	3,469,700.00	0.10
228	601788	光大证券	239,842	3,460,920.06	0.10
229	601111	中国国航	568,700	3,440,635.00	0.10
230	600029	南方航空	660,690	3,422,374.20	0.10
231	600415	小商品城	334,800	3,401,568.00	0.10
232	600674	川投能源	240,000	3,400,800.00	0.10
233	601456	国联民生	384,300	3,397,212.00	0.10
234	600219	南山铝业	841,300	3,356,787.00	0.09
235	601186	中国铁建	561,500	3,340,925.00	0.09
236	601881	中国银河	265,600	3,338,592.00	0.09

237	601117	中国化学	448,200	3,294,270.00	0.09
238	601877	正泰电器	131,215	3,289,560.05	0.09
239	600233	圆通速递	208,700	3,287,025.00	0.09
240	301269	华大九天	27,111	3,237,595.62	0.09
241	600372	中航机载	296,900	3,221,365.00	0.09
242	301236	软通动力	75,700	3,213,465.00	0.09
243	601878	浙商证券	337,050	3,201,975.00	0.09
244	000963	华东医药	108,400	3,048,208.00	0.09
245	002920	德赛西威	37,000	3,015,500.00	0.08
246	688506	百利天恒	10,249	3,013,513.47	0.08
247	600741	华域汽车	193,540	3,003,740.80	0.08
248	001979	招商蛇口	441,851	2,841,101.93	0.08
249	000895	双汇发展	126,600	2,835,840.00	0.08
250	002304	洋河股份	73,495	2,803,834.25	0.08
251	300866	安克创新	26,600	2,779,700.00	0.08
252	601898	中煤能源	223,500	2,722,230.00	0.08
253	601021	春秋航空	59,568	2,715,109.44	0.08
254	601319	中国人保	390,000	2,636,400.00	0.07
255	600023	浙能电力	491,400	2,584,764.00	0.07
256	600039	四川路桥	319,320	2,497,082.40	0.07
257	601800	中国交建	436,100	2,490,131.00	0.07
258	000002	万　　科A	837,501	2,479,002.96	0.07
259	688223	晶科能源	500,853	2,379,051.75	0.07
260	601633	长城汽车	153,504	2,316,375.36	0.06
261	600588	用友网络	252,061	2,313,919.98	0.06
262	001965	招商公路	249,100	2,281,756.00	0.06
263	600600	青岛啤酒	43,128	2,252,575.44	0.06
264	603369	今世缘	91,900	2,178,949.00	0.06
265	600027	华电国际	483,900	2,153,355.00	0.06
266	302132	中航成飞	36,700	2,140,344.00	0.06
267	601618	中国中冶	869,500	2,121,580.00	0.06
268	300628	亿联网络	61,880	2,092,781.60	0.06
269	601607	上海医药	135,700	2,089,780.00	0.06
270	603260	合盛硅业	43,000	2,075,180.00	0.06
271	600918	中泰证券	389,500	2,072,140.00	0.06
272	600025	华能水电	229,592	2,041,072.88	0.06
273	600061	国投资本	311,437	2,039,912.35	0.06
274	000617	中油资本	307,900	2,029,061.00	0.06
275	300832	新产业	48,000	2,016,000.00	0.06
276	300251	光线传媒	180,000	1,996,200.00	0.06
277	600930	华电新能	410,300	1,957,131.00	0.05
278	688472	阿特斯	180,149	1,949,212.18	0.05
279	600085	同仁堂	83,700	1,934,307.00	0.05

280	601059	信达证券	118,500	1,918,515.00	0.05
281	600515	海南机场	693,700	1,900,738.00	0.05
282	000999	华润三九	81,909	1,842,133.41	0.05
283	600803	新奥股份	113,700	1,796,460.00	0.05
284	600018	上港集团	370,700	1,749,704.00	0.05
285	600845	宝信软件	105,129	1,748,295.27	0.05
286	300122	智飞生物	145,917	1,705,769.73	0.05
287	300999	金龙鱼	72,500	1,686,350.00	0.05
288	300896	爱美客	18,740	1,634,128.00	0.05
289	000596	古井贡酒	20,128	1,606,214.40	0.05
290	000708	中信特钢	123,000	1,552,260.00	0.04
291	688009	中国通号	318,464	1,515,888.64	0.04
292	601018	宁波港	480,000	1,512,000.00	0.04
293	601238	广汽集团	270,820	1,375,765.60	0.04
294	001280	中国铀业	20,477	1,365,815.90	0.04
295	300413	芒果超媒	92,930	1,359,565.90	0.04
296	688303	大全能源	77,937	1,358,441.91	0.04
297	301165	锐捷网络	16,700	1,343,515.00	0.04
298	603392	万泰生物	46,431	1,252,244.07	0.04
299	601136	首创证券	66,100	922,095.00	0.03
300	001391	国货航	179,900	732,193.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.21
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.09
3	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.07
4	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.02
5	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.02
6	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
7	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.01
8	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
9	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.01
10	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
11	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
12	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
13	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
14	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
15	920072	科莱瑞迪	2,799	105,942.15	0.00
16	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
17	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
18	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00

19	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
20	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
21	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
22	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
23	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
24	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
25	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
26	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
27	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
28	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
29	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
30	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
31	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
32	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
33	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
34	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
35	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
36	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
37	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
38	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
39	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
40	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
41	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
42	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
43	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
44	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	000988	华工科技	19,129,250.66	0.47
2	300750	宁德时代	18,570,960.00	0.46
3	301308	江波龙	16,452,603.00	0.40
4	688072	拓荆科技	16,031,768.27	0.39
5	300308	中际旭创	14,323,340.00	0.35
6	688521	芯原股份	11,930,959.78	0.29
7	002353	杰瑞股份	11,424,702.00	0.28
8	002602	世纪华通	10,788,356.00	0.26
9	000657	中钨高新	9,198,750.00	0.23
10	300502	新易盛	9,149,005.00	0.22
11	600549	厦门钨业	8,684,021.33	0.21
12	688012	中微公司	7,398,940.69	0.18

13	002202	金风科技	7,368,114.00	0.18
14	300394	天孚通信	6,635,639.16	0.16
15	002837	英维克	6,517,142.70	0.16
16	000333	美的集团	6,334,722.00	0.16
17	300450	先导智能	5,797,118.00	0.14
18	600118	中国卫星	5,709,291.00	0.14
19	601727	上海电气	5,655,718.00	0.14
20	002532	天山铝业	5,481,438.00	0.13

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	54,857,643.76	1.35
2	300308	中际旭创	41,331,479.13	1.01
3	300502	新易盛	25,427,354.44	0.62
4	000333	美的集团	20,430,564.98	0.50
5	002475	立讯精密	15,420,624.00	0.38
6	300059	东方财富	14,747,318.00	0.36
7	002371	北方华创	14,144,044.02	0.35
8	002594	比亚迪	14,071,244.33	0.35
9	300394	天孚通信	11,189,118.00	0.27
10	300274	阳光电源	10,834,207.65	0.27
11	000858	五 粮 液	9,462,005.11	0.23
12	000651	格力电器	9,340,940.24	0.23
13	000725	京东方 A	9,182,226.00	0.23
14	300476	胜宏科技	9,048,412.00	0.22
15	002230	科大讯飞	8,383,308.00	0.21
16	002384	东山精密	7,582,905.00	0.19
17	688256	寒武纪	7,080,776.91	0.17
18	300124	汇川技术	7,012,043.00	0.17
19	000338	潍柴动力	6,834,337.79	0.17
20	002714	牧原股份	6,753,624.00	0.17

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	392,934,641.25
卖出股票收入（成交）总额	672,323,480.91

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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	8,866,450.42
2	应收清算款	1,719,604.93
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	10,586,055.35

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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.21	新股锁定
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.09	新股锁定
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.07	新股锁定
4	001248	华润新能源	595,206.03	0.02	新股锁定
4	001248	华润新能源	255,085.41	0.01	新股未上市
5	688765	禾元生物	799,783.20	0.02	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
2,276	298,600.48	661,871,041.00	97.39	17,743,660.00	2.61

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国农业银行股份有限公司-工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	28,169,300.00	4.14

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 5 月 20 日）基金份额总额	6,863,688,383.00
本报告期期初基金份额总额	844,314,701.00
本报告期基金总申购份额	82,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	247,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	679,614,701.00

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，本基金托管人无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无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(%)	
国信证券	1	635,174,673.31	59.83	86,319.74	59.83	-
中信建投	3	378,835,308.96	35.69	51,484.36	35.69	-
华泰证券	2	37,582,020.74	3.54	5,107.73	3.54	-
申万宏源	1	8,572,797.10	0.81	1,165.28	0.81	-
中金公司	2	1,401,958.75	0.13	190.53	0.13	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国联民生证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	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	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-

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。

本报告期内本基金新租中信建投 1 个交易单元，中信证券 2 个交易单元。

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(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

1	工银瑞信基金管理有限公司关于终止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基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	中国证监会规定的媒介	2026 年 3 月 31 日
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	584,129,672.00	-	-	584,129,672.00	85.95
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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、《工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbcubs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日