

# 工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金		
基金简称	工银中证环保产业指数分级		
场内简称	环保母基		
基金主代码	164819		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 月 9 日		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	27,841,841.77 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 27 日		
下属分级基金的基金简称	环保 A 端	环保 B 端	环保母基
下属分级基金的交易代码	150323	150324	164819
报告期末下属分级基金的份额总额	2,825,593.00 份	2,825,593.00 份	22,190,655.77 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股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及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足、成分股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股

	票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过 0.35%,偏离度年化标准差不超过 4%。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数表现,目标为获取指数的平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。工银环保 A 份额具有低风险、低预期收益的特征;工银环保 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

### 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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱碧艳	韩鑫普
	联系电话	400-811-9999	0755-82943666
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	95565
传真		010-66583158	0755-82960794
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		100033	518000
法定代表人		王海璐	霍达

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人或基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	-1,089,443.52
本期利润	1,083,716.75
加权平均基金份额本期利润	0.0487
本期加权平均净值利润率	6.43%
本期基金份额净值增长率	3.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-22,165,476.58
期末可供分配基金份额利润	-0.7961
期末基金资产净值	21,639,708.37
期末基金份额净值	0.7772
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-43.38%

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。

5、本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 9 日。

#### 3.2 基金净值表现

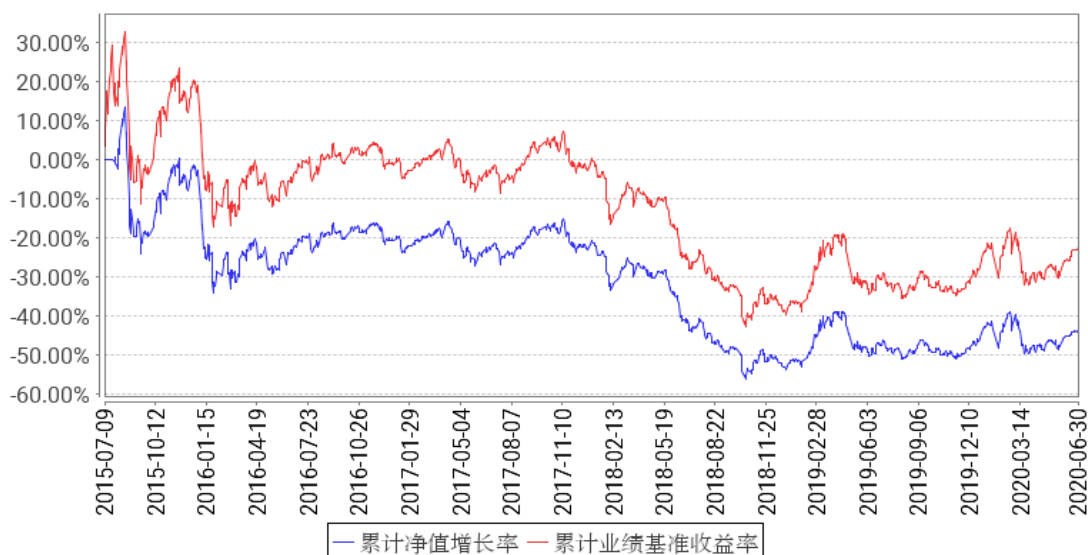
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.88%	0.70%	9.42%	0.83%	-1.54%	-0.13%
过去三个月	12.04%	1.10%	13.98%	1.16%	-1.94%	-0.06%

过去六个月	3.94%	1.76%	6.69%	1.80%	-2.75%	-0.04%
过去一年	7.94%	1.41%	12.20%	1.45%	-4.26%	-0.04%
过去三年	-26.89%	1.39%	-19.95%	1.40%	-6.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-43.38%	1.58%	-22.27%	1.66%	-21.11%	-0.08%

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

工银中证环保产业指数分级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 7 月 9 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，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：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证环保产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。



### 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

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，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。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、私募资产管理计划、企业年金、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、企业年金养老产品、职业年金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。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金、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等逾 150 只公募基金。

公司始终坚持“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，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

#### 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		
赵栩	指数投资	2015 年 7 月	-	12 年	2008 年加入工银瑞信，曾任风险管理部金

	中心投资部 副 总 监，本基金的基金经理	月 9 日			融工程分析师，现任指数投资中心投资部副总监，2011 年 10 月 18 日至今担任工银上证央企 ETF 基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今担任工银深证红利 ETF 基金基金经理；2012 年 10 月 9 日至今担任工银深证红利 ETF 连接基金基金经理，2015 年 7 月 9 日至今担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理，2015 年 7 月 9 日至今担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理，2017 年 12 月 25 日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 21 日至今担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2018 年 12 月 7 日至今担任工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 25 日至今担任工银瑞信上证 50 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。2019 年 12 月 19 日至今，担任工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 2 月 18 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；2020 年 4 月 24 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金基金经理；2020 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；2020 年 6 月 1 日至今，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。
--	----------------------	-------	--	--	--

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控

制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期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2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

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) 指数成份股调整的影响等。

#### 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3.94%，业绩比较基准收益率为6.69%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

(1) 职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

(2) 专业胜任能力及相关工作经历

小组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

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

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

尚无已签约的任何定价服务。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，并经托管银行复核确认。

#### 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，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本基金在报告期内出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，根据 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，我司已向证监会递交解决方案，并说明有关情况。

## § 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

## § 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：工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,230,573.89	1,217,137.85
结算备付金		-	-
存出保证金		2,568.97	3,627.85
交易性金融资产	6.4.7.2	19,907,161.01	15,916,439.24
其中：股票投资		19,907,161.01	15,916,439.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,391.73	613.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	12,855.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		32,142,695.60	17,150,673.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付证券清算款		708.23	-
应付赎回款		10,258,986.96	136,757.94
应付管理人报酬		21,012.96	14,012.55
应付托管费		4,202.60	2,802.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	19,639.87	3,087.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,436.61	90,184.52
负债合计		10,502,987.23	246,845.06
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	38,216,408.02	31,032,938.35
未分配利润	6.4.7.10	-16,576,699.65	-14,129,109.86
所有者权益合计		21,639,708.37	16,903,828.49
负债和所有者权益总计		32,142,695.60	17,150,673.55

注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 9 日。

2、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额为 27,841,841.77 份，其中环保 A 端基金份额总额为 2,825,593.00 份，基金份额净值 1.0270 元；环保 B 端基金份额总额为 2,825,593.00 份，基金份额净值 0.5274 元；环保母基金基金份额总额为 22,190,655.77 份，基金份额净值 0.7772 元。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,420,507.10	2,432,471.28
1. 利息收入		20,240.43	12,005.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,240.43	12,005.86
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			-	-
证券出借利息收入			-	-
其他利息收入			-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）			-794,447.48	-3,460,119.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12		-878,881.34	-3,566,442.98
基金投资收益	-		-	-
债券投资收益	6.4.7.13		-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5		-	-
收益				
贵金属投资收益	6.4.7.14		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15		-	-
股利收益	6.4.7.16		84,433.86	106,323.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17		2,173,160.27	5,874,313.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18		21,553.88	6,270.86
减：二、费用			336,790.35	284,441.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1		84,733.17	93,845.31
2. 托管费	6.4.10.2.2		16,946.64	18,769.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19		40,384.50	22,238.38
5. 利息支出			-	-
其中：卖出回购金融资产支出			-	-
6. 税金及附加			-	-
7. 其他费用	6.4.7.20		194,726.04	149,588.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			1,083,716.75	2,148,030.01
减：所得税费用			-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			1,083,716.75	2,148,030.01

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 9 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	31,032,938.35	-14,129,109.86	16,903,828.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,083,716.75	1,083,716.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	7,183,469.67	-3,531,306.54	3,652,163.13
其中：1. 基金申购款	33,752,720.65	-15,163,623.03	18,589,097.62
2. 基金赎回款	-26,569,250.98	11,632,316.49	-14,936,934.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	38,216,408.02	-16,576,699.65	21,639,708.37
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	37,377,290.22	-19,776,623.94	17,600,666.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,148,030.01	2,148,030.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,106,578.83	1,333,752.65	-1,772,826.18
其中：1. 基金申购款	3,081,270.00	-1,407,685.15	1,673,584.85
2. 基金赎回款	-6,187,848.83	2,741,437.80	-3,446,411.03



回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	34,270,711.39	-16,294,841.28	17,975,870.11

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 9 日。

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：

王海璐

赵紫英

关亚君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1104 号文《关于准予工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金募集的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2015 年 7 月 9 日正式生效，首次设立募集规模为 236,352,075.41 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金的基金份额包括工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之基础份额（简称“工银环保份额”）、工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之 A 份额（简称“工银环保 A 份额”）和工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之 B 份额（简称“工银环保 B 份额”）。其中，工银环保 A 份额、工银环保 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比率不变。本基金合同生效后，工银环保份额可办理场外与场内申购和赎回；工银环保 A 份额、工银环保 B 份额只上市交易，不可单独申购和赎回。基金管理人将根据基金合同的约定办理场内工银环保份额与工银环保 A 份额、工银环保 B 份额之间的份额配对转换业务。基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算，折算后基金运作方式及工银环保 A 份额与工银环保 B 份额配比不变。

每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）1 月份的第一个工作日为基金份额定期折算基准日，本基金将对登记在册的工银环保份额、工银环保 A 份额进行基金的定期份额折算。但基金合同生效日至第 1 个定期份额折算基准日不足 6 个月的，则该年度可不进行定期份额折算；

定期份额折算基准日前 1 个月内发生过不定期份额折算的，则该年度可不进行定期份额折算。

工银环保 A 份额和工银环保 B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对工银环保 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份工银环保份额将按 1 份工银环保 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，工银环保 A 份额和工银环保 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于工银环保 A 份额的约定年化应得收益，即除基金合同另有约定外，工银环保 A 份额每个基金份额定期折算基准日份额参考净值超过人民币 1.0000 元的部分，将折算为场内工银环保份额分配给工银环保 A 份额持有人。工银环保份额持有人持有的每 2 份工银环保份额将按 1 份工银环保 A 份额获得新增工银环保份额的分配。持有场外工银环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外工银环保份额的分配；持有场内工银环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内工银环保份额的分配。经过上述份额折算，工银环保 A 份额和工银环保份额的基金份额（参考）净值将相应调整。

本基金在存续期内，将在每个工作日对工银环保基金份额净值、工银环保 A 份额和工银环保 B 份额参考净值分别计算，如工银环保份额的基金净值达到人民币 1.5000 元或工银环保 B 份额的基金份额参考净值达到人民币 0.2500 元时进行份额折算。当工银环保份额的基金份额净值达到人民币 1.5000 元时，基金管理人应确定基金份额折算基准日，并在折算基准日，本基金将对登记在册的工银环保份额、工银环保 A 份额和工银环保 B 份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保工银环保 A 份额和工银环保 B 份额的比例为 1:1；份额折算后工银环保份额的基金份额净值、工银环保 A 份额和工银环保 B 份额的参考净值均调整为人民币 1.0000 元。当工银环保 B 份额的参考净值达到人民币 0.2500 元时，基金管理人应确定基金份额折算基准日。在折算基准日，对基金份额折算基准日登记在册的工银环保份额、工银环保 A 份额和工银环保 B 份额进行分别折算。份额折算后工银环保份额基金份额净值、工银环保 A 和工银环保 B 份额的基金份额参考净值均调整为人民币 1.0000 元；折算后将保持工银环保 A 和工银环保 B 份额的比例为 1:1。

工银环保份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；工银环保份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。工银环保 A（或工银环保 B）的新增工银环保场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证环保产业指数的成份股及其备选成份股、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、股指期货、权证以及经中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的规定）。法律法规或监管机构以后允许基金投

资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证环保产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金投资组合的业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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；

### (2) 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生

的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	12,230,573.89
定期存款	-
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	-
合计	12,230,573.89

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,132,972.62	19,907,161.01	774,188.39
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	19,132,972.62	19,907,161.01	774,188.39

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 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。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,390.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.10
合计	2,391.73

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	19,639.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	19,639.87

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	53,710.57
应付证券出借违约金	-
预提审计费	19,890.78
指数使用费	50,000.00
上市年费	29,835.26
其他	45,000.00
合计	198,436.61

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,820,771.95	31,032,938.35
本期申购	6,451.57	9,175.57

本期赎回（以“-”号填列）	-23,994.48	-34,125.80
2020年01月02日 基金拆分/ 份额折算前	21,803,229.04	31,007,988.12
基金拆分/份额折算调整	786,884.33	-
本期申购	24,582,446.89	33,743,545.08
本期赎回（以“-”号填列）	-19,330,718.49	-26,535,125.18
本期末	27,841,841.77	38,216,408.02

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。

#### 6.4.7.10 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	-17,269,740.09	3,140,630.23	-14,129,109.86
本期利润	-1,089,443.52	2,173,160.27	1,083,716.75
本期基金份额交易 产生的变动数	-3,806,292.97	274,986.43	-3,531,306.54
其中：基金申购款	-19,221,548.27	4,057,925.24	-15,163,623.03
基金赎回款	15,415,255.30	-3,782,938.81	11,632,316.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,165,476.58	5,588,776.93	-16,576,699.65

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	19,794.65
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	28.57
其他	417.21
合计	20,240.43

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-878,881.34
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-878,881.34



## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,040,106.14
减：卖出股票成本总额	16,918,987.48
买卖股票差价收入	-878,881.34

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	84,433.86
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	84,433.86

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	2,173,160.27
股票投资	2,173,160.27
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	-
权证投资	-
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	2,173,160.27

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	21,553.88
合计	21,553.88

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	40,384.50
银行间市场交易费用	-
合计	40,384.50

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	-
证券出借违约金	-
持有人大会公证费	10,000.00
律师费用	35,000.00
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,835.26
合计	194,726.04

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》和《关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定，基金管理人已向深圳证券交易所申请工银瑞信中证环保产业指数分级

证券投资基金终止上市交易，获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2020]641号）同意，本基金于2020年7月28日终止上市。基金管理人自2020年7月28日起根据法律法规、基金合同等规定履行基金资产清算程序，并已于8月20日披露基金清算公告，具体情况详见本基金管理人的相关公告。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
招商证券股份有限公司	34,776,655.12	100.00	17,779,590.77	100.00

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券股份有 限公司	21,259.15	100.00	19,639.87	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券股份有 限公司	10,868.82	100.00	9,990.88	100.00

## 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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	84,733.17	93,845.31
其中：支付销售机构的客户维护费	14,858.55	17,290.12

注：基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,946.64	18,769.01

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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自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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
招商证券股份有 限公司	12,230,573.89	19,794.65	1,308,931.38	11,929.81

#### 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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、内控稽核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。同时制定了系统化的风险管理程序，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，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施。在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策，公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不



超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

#### 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可随时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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过

独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2020年6月30日							
资产							
银行存款	12,230,573.89	-	-	-	-	-	12,230,573.89
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,568.97	-	-	-	-	-	2,568.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	19,907,161.01	19,907,161.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,391.73	2,391.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,233,142.86	-	-	-	-	19,909,552.74	32,142,695.60
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	708.23	708.23
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,258,986.96	10,258,986.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,012.96	21,012.96
应付托管费	-	-	-	-	-	4,202.60	4,202.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	19,639.87	19,639.87
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	198,436.61	198,436.61
负债总计	-	-	-	-	-	10,502,987.23	10,502,987.23
利率敏感度缺口	12,233,142.86	-	-	-	-	9,406,565.51	21,639,708.37
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,217,137.85	-	-	-	-	-	1,217,137.85
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	3,627.85	-	-	-	-	-	3,627.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	15,916,439.24	15,916,439.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	613.56	613.56
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	12,855.05	12,855.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,220,765.70	-	-	-	-	15,929,907.85	17,150,673.55
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	136,757.94	136,757.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,012.55	14,012.55
应付托管费	-	-	-	-	-	2,802.51	2,802.51
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,087.54	3,087.54
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	90,184.52	90,184.52
负债总计	-	-	-	-	-	246,845.06	246,845.06
利率敏感度缺口	1,220,765.70	-	-	-	-	15,683,062.79	16,903,828.49

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此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

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等方面问题的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并应用量化模型进行优化计算，根据计算结果和风险的评估、建议适时、动态地调整基金资产在股票、债券、现金三大类资产的配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的资产比例不低于基金资产净值的 90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金

的基金管理人每日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对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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 2020年6月30日		上年度末 2019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	19,907,161.01	91.99	15,916,439.24	94.16
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	19,907,161.01	91.99	15,916,439.24	94.16

注：1、本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证环保产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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。

#### 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。		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	

分析	业绩比较基准增加 5%	1,054,186.77	822,551.09
	业绩比较基准减少 5%	-1,054,186.77	-822,551.09

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	19,907,161.01	61.93
	其中：股票	19,907,161.01	61.93
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	12,230,573.89	38.05
8	其他各项资产	4,960.70	0.02
9	合计	32,142,695.60	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	13,398,786.89	61.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,875,787.64	13.29
E	建筑业	557,168.40	2.57
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	771,972.00	3.57
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	2,082,186.08	9.62
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	221,260.00	1.02
	合计	19,907,161.01	91.99

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。

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600884	杉杉股份	21,800	257,022.00	1.19
2	601865	福莱特	13,200	248,160.00	1.15



3	603806	福斯特	4,807	239,917.37	1.11
4	601012	隆基股份	5,882	239,573.86	1.11
5	300751	迈为股份	800	237,568.00	1.10
6	300037	新宙邦	4,300	236,758.00	1.09
7	002459	晶澳科技	12,500	234,750.00	1.08
8	300014	亿纬锂能	4,862	232,646.70	1.08
9	300724	捷佳伟创	2,600	230,178.00	1.06
10	300618	寒锐钴业	3,680	228,233.60	1.05
11	002745	木林森	14,800	228,068.00	1.05
12	300274	阳光电源	15,780	227,074.20	1.05
13	600438	通威股份	12,800	222,464.00	1.03
14	002850	科达利	3,200	221,440.00	1.02
15	000009	中国宝安	26,000	221,260.00	1.02
16	300118	东方日升	14,600	219,000.00	1.01
17	600563	法拉电子	3,500	216,300.00	1.00
18	002709	天赐材料	6,380	215,580.20	1.00
19	300073	当升科技	6,500	214,955.00	0.99
20	300207	欣旺达	11,300	213,570.00	0.99
21	002028	思源电气	10,400	212,784.00	0.98
22	002129	中环股份	9,400	211,124.00	0.98
23	300750	宁德时代	1,200	209,232.00	0.97
24	300316	晶盛机电	8,430	208,558.20	0.96
25	300815	玉禾田	1,700	208,488.00	0.96
26	600483	福能股份	28,600	207,636.00	0.96
27	002340	格林美	41,760	207,547.20	0.96
28	603218	日月股份	11,340	207,522.00	0.96
29	603659	璞泰来	2,000	206,040.00	0.95
30	603799	华友钴业	5,300	205,958.00	0.95
31	002080	中材科技	13,238	205,189.00	0.95
32	300776	帝尔激光	2,440	204,423.20	0.94
33	002460	赣锋锂业	3,800	203,566.00	0.94
34	600116	三峡水利	22,800	202,692.00	0.94
35	600900	长江电力	10,600	200,764.00	0.93
36	300376	易事特	38,500	200,200.00	0.93
37	603568	伟明环保	8,560	198,592.00	0.92
38	600406	国电南瑞	9,800	198,450.00	0.92
39	300457	赢合科技	6,200	197,656.00	0.91
40	601877	正泰电器	7,500	197,625.00	0.91
41	002056	横店东磁	17,564	197,595.00	0.91
42	000035	中国天楹	38,700	197,370.00	0.91
43	002973	侨银环保	8,400	196,896.00	0.91
44	603421	鼎信通讯	13,100	196,238.00	0.91

45	601222	林洋能源	35,800	195,468.00	0.90
46	300001	特锐德	9,300	194,742.00	0.90
47	600674	川投能源	21,000	194,670.00	0.90
48	300072	三聚环保	45,411	194,359.08	0.90
49	300450	先导智能	4,200	194,082.00	0.90
50	600025	华能水电	51,100	193,669.00	0.89
51	603515	欧普照明	7,070	193,505.90	0.89
52	000591	太阳能	57,040	192,795.20	0.89
53	300296	利亚德	31,650	192,115.50	0.89
54	300070	碧水源	23,559	191,299.08	0.88
55	300682	朗新科技	11,200	190,624.00	0.88
56	601615	明阳智能	15,300	190,485.00	0.88
57	600886	国投电力	24,200	190,212.00	0.88
58	002531	天顺风能	31,800	190,164.00	0.88
59	003816	中国广核	64,000	189,440.00	0.88
60	002506	协鑫集成	72,400	188,964.00	0.87
61	600021	上海电力	25,500	188,700.00	0.87
62	600388	龙净环保	21,443	188,698.40	0.87
63	300068	南都电源	17,700	188,682.00	0.87
64	002466	天齐锂业	8,220	188,649.00	0.87
65	601985	中国核电	45,900	187,731.00	0.87
66	000400	许继电气	14,219	187,690.80	0.87
67	601200	上海环境	15,640	187,680.00	0.87
68	601330	绿色动力	19,700	187,150.00	0.86
69	300365	恒华科技	18,300	186,660.00	0.86
70	601611	中国核建	30,200	186,636.00	0.86
71	601727	上海电气	37,000	186,480.00	0.86
72	000690	宝新能源	39,500	186,440.00	0.86
73	600517	国网英大	27,900	186,372.00	0.86
74	601016	节能风电	87,900	186,348.00	0.86
75	600312	平高电气	25,100	186,242.00	0.86
76	002202	金风科技	18,657	186,010.29	0.86
77	600874	创业环保	27,996	185,893.44	0.86
78	600008	首创股份	61,700	185,717.00	0.86
79	600068	葛洲坝	31,200	185,640.00	0.86
80	600487	亨通光电	11,300	185,433.00	0.86
81	600703	三安光电	7,400	185,000.00	0.85
82	600875	东方电气	20,900	184,965.00	0.85
83	002310	东方园林	38,280	184,892.40	0.85
84	600869	智慧能源	46,200	184,800.00	0.85
85	600549	厦门钨业	15,600	184,704.00	0.85
86	300203	聚光科技	11,031	184,548.63	0.85

87	000967	盈峰环境	22,300	183,975.00	0.85
88	000598	兴蓉环境	39,800	183,080.00	0.85
89	000826	启迪环境	24,600	182,532.00	0.84
90	600089	特变电工	26,942	182,397.34	0.84
91	600482	中国动力	11,600	182,120.00	0.84
92	600323	瀚蓝环境	8,300	181,604.00	0.84
93	601179	中国西电	37,500	181,500.00	0.84
94	300232	洲明科技	22,418	181,361.62	0.84
95	002266	浙富控股	46,700	180,729.00	0.84
96	600217	中再资环	37,100	178,822.00	0.83
97	002617	露笑科技	36,700	178,362.00	0.82
98	002074	国轩高科	6,600	177,144.00	0.82
99	002665	首航高科	72,095	175,911.80	0.81
100	300495	美尚生态	17,500	166,600.00	0.77

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

无。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300751	迈为股份	297,308.00	1.76
2	002973	侨银环保	292,775.00	1.73
3	300815	玉禾田	291,997.00	1.73
4	600312	平高电气	290,160.00	1.72
5	300365	恒华科技	289,109.00	1.71
6	003816	中国广核	289,010.00	1.71
7	600563	法拉电子	287,729.00	1.70
8	002459	晶澳科技	285,258.00	1.69
9	600217	中再资环	285,052.00	1.69
10	601611	中国核建	284,480.00	1.68
11	603421	鼎信通讯	283,373.00	1.68
12	600487	亨通光电	282,771.00	1.67
13	601179	中国西电	281,228.00	1.66
14	600549	厦门钨业	280,899.00	1.66
15	300682	朗新科技	280,387.00	1.66
16	600517	国网英大	280,318.00	1.66
17	300068	南都电源	278,108.00	1.65
18	600869	智慧能源	277,110.00	1.64
19	000009	中国宝安	274,982.00	1.63
20	600483	福能股份	274,908.00	1.63

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	002594	比亚迪	227,071.59	1.34
2	002384	东山精密	206,873.00	1.22
3	603693	江苏新能	191,881.00	1.14
4	300124	汇川技术	182,564.00	1.08
5	600733	北汽蓝谷	173,938.00	1.03
6	000581	威孚高科	171,110.00	1.01
7	300724	捷佳伟创	166,456.00	0.98
8	002460	赣锋锂业	164,504.00	0.97
9	601865	福莱特	163,164.00	0.97
10	601012	隆基股份	162,607.00	0.96
11	002709	天赐材料	160,908.00	0.95
12	002611	东方精工	160,119.00	0.95
13	002129	中环股份	159,892.00	0.95
14	000012	南玻A	158,472.90	0.94
15	300316	晶盛机电	157,364.00	0.93
16	300457	赢合科技	156,913.00	0.93
17	603806	福斯特	154,594.00	0.91
18	002056	横店东磁	153,584.00	0.91
19	002372	伟星新材	153,128.45	0.91
20	600803	新奥股份	153,124.00	0.91

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	18,736,548.98
卖出股票收入（成交）总额	16,040,106.14

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

## 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

#### 1、晶澳科技

本报告期，本基金持有晶澳科技，其未按规定回购注销激励对象尚未解除限售的限制性股票，为赵志明、宋春华办理了第一个解除限售期的解除限售，解除限售数量分别为 14.40 万股、8 万股，于 2018 年 1 月 22 日上市流通；为赵志明、宋春华、陈群办理了第二个解除限售期的解除限售，解除限售数量分别为 10.8 万股、6 万股、4.8 万股，于 2019 年 1 月 21 日上市流通。违反了

深交所《创业板股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 2.2 条、第 3.1.5 条和第 3.2.2 条的规定。被给予公开关注，及时整改处理。

## 2、新宙邦

本报告期，本基金持有新宙邦，其 2019 年度上半年净利润为负值，却未能在 7 月 15 日之前披露半年度业绩预告。违反了深交所《股票上市规则》第 2.1 条、第 11.3.1 条的规定，被给予公开关注，及时整改处理。

本基金对上述股票的投资属于跟踪标的指数的被动投资，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

## 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,568.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,391.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,960.70

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
环保A端	78	36,225.55	-	-	2,825,593.00	100.00
环保B端	435	6,495.62	163.00	0.01	2,825,430.00	99.99
环保母基	1,764	12,579.74	10,593,220.34	47.74	11,597,435.43	52.26
合计	2,277	12,227.42	10,593,383.34	38.05	17,248,458.43	61.95

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

环保A端

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	施鸿宇	1,663,552.00	58.87
2	傅越千	227,853.00	8.06
3	袁琛	142,195.00	5.03
4	鲍刚	104,610.00	3.70
5	刘辉荣	75,800.00	2.68
6	吴文娟	75,200.00	2.66
7	张瑾	58,536.00	2.07
8	苏全胜	54,977.00	1.95
9	范悦	30,700.00	1.09
10	陈鹭	30,000.00	1.06

环保B端

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	湛国用	348,696.00	12.34
2	吴祯	186,906.00	6.61
3	杨健英	163,490.00	5.79
4	荣代红	107,307.00	3.80

5	周玺昊	96,467.00	3.41
6	黄礼	77,324.00	2.74
7	水冬梅	68,258.00	2.42
8	岑小平	63,059.00	2.23
9	颜瑞金	60,945.00	2.16
10	丁志弘	59,219.00	2.10

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	环保 A 端	0.00	0.00
	环保 B 端	0.00	0.00
	环保母基	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	环保 A 端	环保 B 端	环保母基
基金合同生效日（2015 年 7 月 9 日）基金份额总额	74,737,978.00	74,737,979.00	86,876,118.41
本报告期期初基金份额总额	2,829,588.00	2,829,588.00	16,161,595.95
本报告期基金总申购份额	-	-	24,588,898.46
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	19,354,712.97
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-3,995.00	-3,995.00	794,874.33
本报告期末基金份额总额	2,825,593.00	2,825,593.00	22,190,655.77

注：1、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及折算调整份额，报告期末基金份额



总额为三级份额之和；

2、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

3、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：

基金管理人于 2020 年 2 月 22 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，马成先生自 2020 年 2 月 21 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	34,776,655.12	100.00%	21,259.15	100.00%	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- c) 不符合上述要求的券商、咨询机构，若其特定研究领域有突出优势，可一事一议，报公司审批通过后纳入。

(2) 选择程序

- a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。
- b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金定期份额折算业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月2日
2	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间环保 A 份额停复牌的公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月3日
3	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之 A 份额 2020 年度约定年基准收益率的公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月3日
4	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月6日
5	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之 A 份额定期折算后次日收盘价调整的风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月6日
6	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月9日
7	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月14日
8	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月17日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金春节假期延长期间交易规则的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020年1月29日
10	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年2月5日
11	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年2月10日
12	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020年2月13日
13	关于调整旗下部分基金在直销电子交易系统最低定期定额投资金额及最低转换份额的公告	中国证监会规定的媒介	2020年2月14日
14	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会规定的媒介	2020年2月22日
15	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020年2月28日

16	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 13 日
17	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 19 日
18	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 20 日
19	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 23 日
20	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 24 日
21	关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 25 日
22	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 25 日
23	工银瑞信基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 26 日
24	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 26 日
25	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 27 日
26	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 30 日
27	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 3 月 31 日
28	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 1 日
29	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 2 日
30	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 3 日
31	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 7 日
32	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 8 日
33	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 9 日
34	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 10 日
35	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 13 日
36	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 14 日

37	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 15 日
38	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 16 日
39	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 17 日
40	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 20 日
41	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 21 日
42	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 22 日
43	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 24 日
44	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 27 日
45	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 28 日
46	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 29 日
47	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 30 日
48	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 6 日
49	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 8 日
50	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 11 日
51	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 12 日
52	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 13 日
53	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 14 日
54	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 18 日
55	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 19 日
56	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 20 日
57	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 21 日
58	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 22 日

59	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 25 日
60	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 26 日
61	工银瑞信基金管理有限公司关于终止中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 26 日
62	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 27 日
63	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 28 日
64	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 5 月 29 日
65	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 1 日
66	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 2 日
67	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 3 日
68	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 4 日
69	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 5 日
70	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 8 日
71	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 9 日
72	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金恢复场外申购业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 9 日
73	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金限制大额申购业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 10 日
74	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 10 日

	复牌公告		
75	工银瑞信基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 11 日
76	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 11 日
77	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 12 日
78	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金恢复基金份额拆分业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 12 日
79	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 16 日
80	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 17 日
81	关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金暂停场外申购及场内分拆业务的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 17 日
82	工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开 工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 17 日
83	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 18 日
84	工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开 工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 18 日
85	工银瑞信基金管理有限公司关于以通讯方式召开 工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 19 日
86	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 19 日
87	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 22 日
88	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 23 日
89	工银瑞信中证环保产业指数分级证券	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 24 日

	投资基金 B 类份额溢价风险提示公告		
90	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 月 29 日
91	工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2020 年 6 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	20200610-20200611, 20200629-20200629	-	19,593,220.34	19,593,220.34	-	-
-	2	20200610-20200628	-	13,241,525.42	13,241,525.42	-	-
机构	3	20200612-20200615, 20200623-20200628	-	9,000,000.00	9,000,000.00	-	-
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。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》的规定, 定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金在 2020 年 1 月 2 日办理了定期份额折算业务, 详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金募集申请的注册文件;
- 2、《工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》;
- 3、《工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》;



- 4、《工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日