

# 工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证 券投资基金（LOF） 2021 年中期报告

2021 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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	5
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>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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	43
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	43
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	43
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	43
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12	投资组合报告附注	43
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>44</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	45
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>45</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>46</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>48</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	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>49</b>
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	工银京津冀指数	
场内简称	京津冀	
基金主代码	164811	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 17 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,669,424.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	工银京津冀指数 A	工银京津冀指数 C
下属分级基金的交易代码	164811	164825
报告期末下属分级基金的份额总额	9,924,133.19 份	745,291.15 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。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，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、成份股被限制投资等）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。
业绩比较基准	中证京津冀协同发展主题指数收益率×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	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	罗菲菲
	联系电话	400-811-9999	010-58560666

电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95568
传真	010-66583158	010-58560798
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	赵桂才	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	工银京津冀指数 A	工银京津冀指数 C
本期已实现收益	331,540.92	20,100.27
本期利润	663,855.33	138,520.75
加权平均基金份额本期利润	0.0612	0.1103
本期加权平均净值利润率	5.60%	10.10%

本期基金份额净值增长率	5.88%	5.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-2,661,515.83	55,090.70
期末可供分配基金份额利润	-0.2682	0.0739
期末基金资产净值	11,463,098.58	857,927.99
期末基金份额净值	1.1551	1.1511
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	15.51%	15.11%

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 2018 年 4 月 17 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

工银京津冀指数 A

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	0.80%	0.67%	0.52%	0.68%	0.28%	-0.01%
过去三个月	5.72%	0.77%	5.97%	0.78%	-0.25%	-0.01%

过去六个月	5.88%	0.95%	6.75%	0.96%	-0.87%	-0.01%
过去一年	20.30%	1.17%	21.31%	1.18%	-1.01%	-0.01%
过去三年	15.56%	1.32%	8.35%	1.41%	7.21%	-0.09%
自基金合同生效起 至今	15.51%	1.28%	-11.61%	1.41%	27.12%	-0.13%

## 工银京津冀指数 C

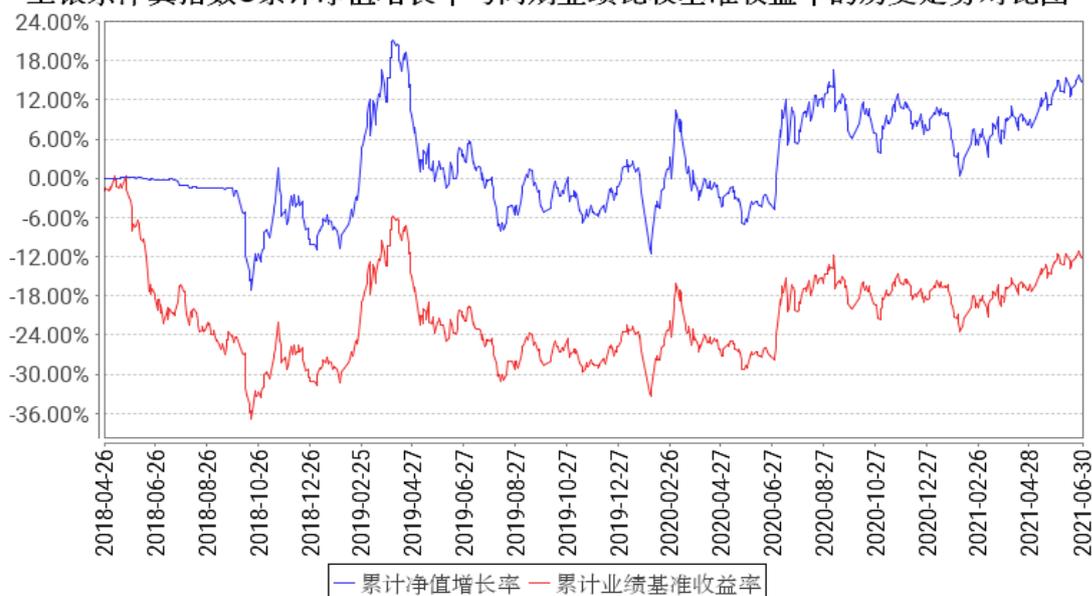
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.78%	0.67%	0.52%	0.68%	0.26%	-0.01%
过去三个月	5.62%	0.77%	5.97%	0.78%	-0.35%	-0.01%
过去六个月	5.71%	0.95%	6.75%	0.96%	-1.04%	-0.01%
过去一年	19.97%	1.17%	21.31%	1.18%	-1.34%	-0.01%
过去三年	15.31%	1.32%	8.35%	1.41%	6.96%	-0.09%
自基金合同生效起 至今	15.11%	1.28%	-11.84%	1.41%	26.95%	-0.13%

### 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

工银京津冀指数A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



工银京津冀指数C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、本基金于 2018 年 4 月 17 日由“工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金”转型而来。

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：本基金投资于中证京津冀协同发展主题指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且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、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、基金公司资管计划、基金子公司资管计划、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。

截至 2021 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、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、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、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、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 6 个月定期开放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、工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金、工银瑞信战略远见混合型证券投资基金、工银瑞信中证科技龙头 ETF 基金、工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金等逾 180 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		
刘伟琳	本基金的基金经理	2018年4月17日	-	11年	中国人民大学金融工程博士；2010年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心产品及营销支持部研究负责人兼指数基金基金经理。2014年10月17日至今，担任工银深证100指数分级基金（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，担任工银沪深300指数基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银中证500指数分级基金（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；2015年5月21日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金（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，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理；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，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11月1日至今，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日至今，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；2021年1月21日至今，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日至今，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 日至今，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。
--	--	--	--	--	---

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，本报告期末出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 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) 指数成分股调整等。

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。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为 5.88%，本基金 C 份额净值增长率为 5.71%，业绩比较基准收益率为 6.75%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，市场主要宽基指数中，沪深 300 指数、中证 500 指数、上证 50 指数、创业板指涨跌幅分别为 0.24%、6.93%、-3.90% 及 17.22%。本基金标的指数在本报告期内涨跌幅为 7.08%，表现优于沪深 300 指数。从市场风格来看，报告期内沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数涨幅分别为 0.28% 和 4.78%，成长风格表现相对较强。从估值水平来看，截至报告期末，沪深 300 指数、中证 500 指数、上证 50 指数、创业板指的市盈率分别为 14.77、22.01、12.49 及 63.11 倍，除中证 500 指数外，主要指数估值历史分位数处于较高水平。

在报告期内，A 股市场经历了较大的市场波动，年初出现较快上涨的行情，春节之后，各主要板块及市场指数均出现了较大的波动，进入到 2 季度市场整体有所企稳，同时也出现了一些分化的行情，市场的风险偏好有一定的提升，整体上结构性行情的特征十分明显。部分具有较好景气度的行业在结构化行情中较为突出，基本面的改善和持续提供了良好的行情支撑。市场对于流动性收紧的担忧有所缓解，未来对于基本面的改善是否持续以及持续多久将成为市场关注的焦点，这同样也是结构性行情下投资者需要加以关注的。

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

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及

利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	955,625.23	1,010,518.90
结算备付金		7,330.66	-
存出保证金		8,668.02	5,222.86
交易性金融资产	6.4.7.2	11,594,419.43	14,371,182.71
其中：股票投资		11,594,419.43	14,371,182.71
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		-	3,900.31
应收利息	6.4.7.5	96.39	106.56
应收股利		-	-
应收申购款		16,329.89	6,217.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,582,469.62	15,397,149.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		134.72	-
应付赎回款		117,736.23	38,022.40
应付管理人报酬		5,183.29	6,481.54
应付托管费		1,036.65	1,296.29
应付销售服务费		192.68	247.45
应付交易费用	6.4.7.7	17,036.58	3,048.53
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	120,122.90	90,075.66
负债合计		261,443.05	139,171.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	7,299,178.23	9,599,737.08
未分配利润	6.4.7.10	5,021,848.34	5,658,240.08
所有者权益合计		12,321,026.57	15,257,977.16
负债和所有者权益总计		12,582,469.62	15,397,149.03

注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 4 月 17 日。

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额为 10,669,424.34 份，其中工银京津冀指数 A 基金份额总额为 9,924,133.19 份，基金份额净值 1.1551 元；工银京津冀指数 C 基金份额总额为 745,291.15 份，基金份额净值 1.1511 元。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,000,216.99	-1,904,195.87
1. 利息收入		2,278.87	6,194.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,278.87	6,194.32
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）		534,741.41	-15,805.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	445,783.14	-231,020.31
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	88,958.27	215,214.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	450,734.89	-1,918,156.13
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	12,461.82	23,571.64
减：二、费用		197,840.91	230,261.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,863.91	58,143.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,572.78	11,628.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,735.91	2,482.98
4. 交易费用	6.4.7.19	36,802.52	35,534.74
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	119,865.79	122,471.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		802,376.08	-2,134,456.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		802,376.08	-2,134,456.92

注：本基金基金合同生效日为 2018 年 4 月 17 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	9,599,737.08	5,658,240.08	15,257,977.16

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	802,376.08	802,376.08
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)	-2,300,558.85	-1,438,767.82	-3,739,326.67
其中:1.基金申购款	12,547,191.68	2,673,115.08	15,220,306.76
2.基金赎回款	-14,847,750.53	-4,111,882.90	-18,959,633.43
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)	7,299,178.23	5,021,848.34	12,321,026.57
项目	上年度可比期间 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)	13,560,798.10	6,394,610.35	19,955,408.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,134,456.92	-2,134,456.92
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)	3,783,382.16	2,388,833.17	6,172,215.33
其中:1.基金申购款	19,700,965.12	6,410,950.08	26,111,915.20
2.基金赎回款	-15,917,582.96	-4,022,116.91	-19,939,699.87
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)	17,344,180.26	6,648,986.60	23,993,166.86

注：本基金基金合同生效日为 2018 年 4 月 17 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：

<u>赵桂才</u>	<u>郝炜</u>	<u>关亚君</u>
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

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由原工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金转型而来。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[2018]113 号《关于准予工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更注册批复》，工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金就基金变更投资目标、投资范围、投资策略及基金费率等事宜进行变更注册。根据基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于 2018 年 3 月 15 日发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信睿智深证 100 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》，原工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金于 2018 年 3 月 14 日以现场方式召开了基金份额持有人大会。依据此次基金份额持有人大会决议，本基金《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF)基金合同》自 2018 年 4 月 17 日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	955,625.23
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	955,625.23

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,258,987.12	11,594,419.43	335,432.31
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		11,258,987.12	11,594,419.43	335,432.31

#### 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	89.19
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	3.30
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	3.90
合计	96.39

#### 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
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	17,036.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,036.58

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	287.11
应付证券出借违约金	-
预提审计费	19,835.79
指数使用费	100,000.00
合计	120,122.90

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银京津冀指数 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	12,920,124.47	8,532,390.84
本期申购	4,170,036.68	2,753,892.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,166,027.96	-4,732,395.90
-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	9,924,133.19	6,553,887.08

工银京津冀指数 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,067,346.24	1,067,346.24
本期申购	9,793,299.54	9,793,299.54
本期赎回 (以“-”号填列)	-10,115,354.63	-10,115,354.63
-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	745,291.15	745,291.15

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

## 工银京津冀指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,891,981.26	9,455,324.91	5,563,343.65
本期利润	331,540.92	332,314.41	663,855.33
本期基金份额交易产生的变动数	898,924.51	-2,216,911.99	-1,317,987.48
其中：基金申购款	-1,285,519.65	3,096,696.93	1,811,177.28
基金赎回款	2,184,444.16	-5,313,608.92	-3,129,164.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,661,515.83	7,570,727.33	4,909,211.50

## 工银京津冀指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,488.19	49,408.24	94,896.43
本期利润	20,100.27	118,420.48	138,520.75
本期基金份额交易产生的变动数	-10,497.76	-110,282.58	-120,780.34
其中：基金申购款	316,779.99	545,157.81	861,937.80
基金赎回款	-327,277.75	-655,440.39	-982,718.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,090.70	57,546.14	112,636.84

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	2,115.58
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	122.25
其他	41.04
合计	2,278.87

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	445,783.14
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	445,783.14

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	15,284,850.20
减：卖出股票成本总额	14,839,067.06
买卖股票差价收入	445,783.14

##### 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	88,958.27
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	88,958.27

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	450,734.89
股票投资	450,734.89
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	450,734.89

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	12,461.82
合计	12,461.82

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	36,802.52
银行间市场交易费用	-
合计	36,802.52

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	30.00
合计	119,865.79

## 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

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	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、基金销售机构

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	32,863.91	58,143.18
其中：支付销售机构的客户维护费	11,160.79	21,596.61

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,572.78	11,628.65

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银京津冀指数 A	工银京津冀指数 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	46.24	46.24

中国民生银行股份有限公司	-	29.81	29.81
合计	-	76.05	76.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银京津冀指数 A	工银京津冀指数 C	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	187.05	187.05
中国民生银行股份有限公司	-	191.13	191.13
合计	-	378.18	378.18

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国民生银行股份有限公司	955,625.23	2,115.58	1,488,739.01	5,934.28

## 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(2021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、信用风险管理团队、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，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、信用风险管理团队、法律合规部和内控稽核部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等，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，内控稽核部负责操作风险和员工异常行为排查的管理和检查。

（3）稽核团队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。本基金通过分散化投资以分散信用风险。

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要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况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。

本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。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 2021年6月30 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	955,625.23	-	-	-	-	-	955,625.23
结算备付金	7,330.66	-	-	-	-	-	7,330.66
存出保证金	8,668.02	-	-	-	-	-	8,668.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	11,594,419.43	11,594,419.43
应收利息	-	-	-	-	-	96.39	96.39
应收申购款	-	-	-	-	-	16,329.89	16,329.89
资产总计	971,623.91	-	-	-	-	11,610,845.71	12,582,469.62
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	134.72	134.72
应付赎回款	-	-	-	-	-	117,736.23	117,736.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,183.29	5,183.29
应付托管费	-	-	-	-	-	1,036.65	1,036.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	192.68	192.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,036.58	17,036.58

其他负债	-	-	-	-	-	120,122.90	120,122.90
负债总计	-	-	-	-	-	261,443.05	261,443.05
利率敏感度缺口	971,623.91	-	-	-	-	11,349,402.66	12,321,026.57
上年度末 2020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	1,010,518.90	-	-	-	-	-	1,010,518.90
存出保证金	5,222.86	-	-	-	-	-	5,222.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	14,371,182.71	14,371,182.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,900.31	3,900.31
应收利息	-	-	-	-	-	106.56	106.56
应收申购款	-	-	-	-	-	6,217.69	6,217.69
资产总计	1,015,741.76	-	-	-	-	14,381,407.27	15,397,149.03
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	38,022.40	38,022.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,481.54	6,481.54
应付托管费	-	-	-	-	-	1,296.29	1,296.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	247.45	247.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,048.53	3,048.53
其他负债	-	-	-	-	-	90,075.66	90,075.66
负债总计	-	-	-	-	-	139,171.87	139,171.87
利率敏感度缺口	1,015,741.76	-	-	-	-	14,242,235.40	15,257,977.16

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

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

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。本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 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 2021年6月30日		上年度末 2020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	11,594,419.43	94.10	14,371,182.71	94.19
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	11,594,419.43	94.10	14,371,182.71	94.19

注：1、本基金投资于中证京津冀协同发展主题指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且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、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。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准增加 5%	608,016.76	748,869.85
	业绩比较基准减少 5%	-608,016.76	-748,869.85

## 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	11,594,419.43	92.15
	其中：股票	11,594,419.43	92.15
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	962,955.89	7.65
8	其他各项资产	25,094.30	0.20
9	合计	12,582,469.62	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	297,682.70	2.42
C	制造业	4,451,916.04	36.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	670,834.30	5.44
E	建筑业	986,132.40	8.00
F	批发和零售业	325,836.00	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,542,615.81	12.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	482,107.70	3.91
J	金融业	465,814.00	3.78
K	房地产业	1,673,194.88	13.58
L	租赁和商务服务业	53,291.60	0.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	644,994.00	5.23
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	11,594,419.43	94.10

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	601919	中远海控	16,000	488,640.00	3.97
2	300117	嘉寓股份	98,480	475,658.40	3.86
3	601633	长城汽车	9,000	392,310.00	3.18
4	600787	中储股份	69,517	370,525.61	3.01
5	300070	碧水源	47,900	350,149.00	2.84
6	000709	河钢股份	140,700	346,122.00	2.81
7	603969	银龙股份	81,100	343,053.00	2.78
8	601000	唐山港	141,900	341,979.00	2.78
9	002542	中化岩土	113,100	341,562.00	2.77
10	600717	天津港	87,110	341,471.20	2.77
11	600155	华创阳安	31,800	340,260.00	2.76
12	601992	金隅集团	125,900	338,671.00	2.75
13	300334	津膜科技	54,000	338,580.00	2.75
14	600008	首创环保	111,630	336,006.30	2.73
15	000959	首钢股份	59,700	335,514.00	2.72
16	600874	创业环保	54,800	334,828.00	2.72
17	002271	东方雨虹	6,050	334,686.00	2.72
18	000778	新兴铸管	88,600	329,592.00	2.68
19	000897	津滨发展	156,700	329,070.00	2.67
20	000401	冀东水泥	26,400	326,040.00	2.65
21	000652	泰达股份	75,600	325,836.00	2.64
22	002743	富煌钢构	54,200	325,742.00	2.64
23	002146	荣盛发展	54,200	305,688.00	2.48
24	000923	河钢资源	15,610	297,682.70	2.42
25	000786	北新建材	7,300	286,525.00	2.33
26	000158	常山北明	23,930	274,955.70	2.23
27	000615	奥园美谷	11,700	257,400.00	2.09
28	600340	华夏幸福	48,850	255,974.00	2.08
29	300075	数字政通	17,600	207,152.00	1.68
30	600480	凌云股份	20,944	191,847.04	1.56
31	600246	万通发展	20,500	184,910.00	1.50

32	600376	首开股份	32,156	180,073.60	1.46
33	002310	东方园林	49,900	170,159.00	1.38
34	300055	万邦达	18,400	168,912.00	1.37
35	600266	城建发展	33,772	160,079.28	1.30
36	600550	保变电气	33,700	140,192.00	1.14
37	002342	巨力索具	30,700	139,378.00	1.13
38	000958	东方能源	28,600	125,554.00	1.02
39	300137	先河环保	14,600	119,282.00	0.97
40	300428	立中集团	8,200	107,502.00	0.87
41	002573	清新环境	18,600	95,976.00	0.78
42	002616	长青集团	7,900	56,880.00	0.46
43	300344	立方数科	9,220	53,291.60	0.43
44	603603	博天环境	5,500	28,710.00	0.23

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	600787	中储股份	392,697.00	2.57
2	600874	创业环保	386,904.00	2.54
3	600340	华夏幸福	380,055.00	2.49
4	002743	富煌钢构	374,083.00	2.45
5	000897	津滨发展	373,235.00	2.45
6	601919	中远海控	368,633.00	2.42
7	000401	冀东水泥	368,119.00	2.41
8	603969	银龙股份	367,716.00	2.41
9	300070	碧水源	360,669.00	2.36
10	600155	华创阳安	358,969.00	2.35
11	000652	泰达股份	358,949.00	2.35
12	300334	津膜科技	354,375.00	2.32
13	601000	唐山港	351,653.00	2.30
14	000923	河钢资源	349,081.00	2.29
15	601992	金隅集团	347,435.00	2.28
16	002146	荣盛发展	342,892.00	2.25
17	002542	中化岩土	327,385.00	2.15
18	600717	天津港	320,543.00	2.10
19	000959	首钢股份	320,290.00	2.10
20	600008	首创环保	313,782.00	2.06
21	300117	嘉寓股份	309,652.00	2.03

22	000778	新兴铸管	306,827.89	2.01
----	--------	------	------------	------

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	601919	中远海控	1,097,886.00	7.20
2	601633	长城汽车	583,556.00	3.82
3	000959	首钢股份	543,334.00	3.56
4	002271	东方雨虹	514,216.00	3.37
5	000709	河钢股份	437,789.00	2.87
6	002310	东方园林	423,953.00	2.78
7	000778	新兴铸管	417,905.00	2.74
8	601000	唐山港	414,546.00	2.72
9	000786	北新建材	411,807.00	2.70
10	600008	首创环保	411,462.00	2.70
11	600717	天津港	409,280.00	2.68
12	000401	冀东水泥	401,535.00	2.63
13	000652	泰达股份	399,707.00	2.62
14	002743	富煌钢构	389,047.00	2.55
15	601992	金隅集团	388,846.00	2.55
16	600787	中储股份	388,773.00	2.55
17	002146	荣盛发展	385,462.00	2.53
18	002542	中化岩土	384,448.00	2.52
19	000923	河钢资源	379,324.00	2.49
20	300070	碧水源	374,959.00	2.46
21	300117	嘉寓股份	367,014.00	2.41
22	600155	华创阳安	359,260.00	2.35
23	600376	首开股份	332,227.00	2.18
24	600480	凌云股份	327,010.60	2.14
25	600340	华夏幸福	315,097.60	2.07

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	11,611,568.89
卖出股票收入（成交）总额	15,284,850.20

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	8,668.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96.39
5	应收申购款	16,329.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,094.30

## 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 (%)
工银京津冀指数 A	2,149	4,618.02	1.03	0.00	9,924,132.16	100.00
工银京津冀指数 C	489	1,524.11	-	-	745,291.15	100.00
合计	2,638	4,044.51	1.03	0.00	10,669,423.31	100.00

## 8.2 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	工银京津冀指数 A	297.96	0.00
	工银京津冀指数 C	111.32	0.01
	合计	409.28	0.00

### 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	份额级别	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	工银京津冀指数 A	-
	工银京津冀指数 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	工银京津冀指数 A	-
	工银京津冀指数 C	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银京津冀指数 A	工银京津冀指数 C
基金合同生效日 (2018 年 4 月 17 日) 基金份额总额	50,960,178.94	-
本报告期期初基金份额总额	12,920,124.47	1,067,346.24
本报告期基金总申购份额	4,170,036.68	9,793,299.54
减：本报告期基金总赎回份额	7,166,027.96	10,115,354.63
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,924,133.19	745,291.15

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：

基金管理人于 2021 年 1 月 16 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，朱碧艳女士自 2021 年 1 月 15 日起代任工银瑞信基金管理有限公司董事长、总经理。

基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布《工银瑞信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，赵桂才先生自 2021 年 2 月 5 日起担任工银瑞信基金管理有限公司董事长，并代任总经理、法定代表人。

#### 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普华永道中天会计师事务所（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	

中泰证券	2	26,896,419.09	100.00%	19,131.08	100.00%	-
东方证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 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在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月1日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月5日
3	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	2021年1月16日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2021年1月29日
5	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	2021年2月6日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2021年3月31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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20210401-20210408	-	7,406,567.17	7,406,567.17	-	-
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

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF) 根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，对《基金合同》和《托管协议》进行了修订，并在投资范围中增加存托凭证，修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 3 月 31 日起生效，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睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日