

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证 券投资基金（LOF）清算报告

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

清算报告出具日：二零二四年一月二十六日

清算报告公告日：二零二四年一月三十一日

§ 1 重要提示及目录

§ 1.1 重要提示

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）（以下或简称“本基金”）由工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更而来。工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金经中国证监会 2012 年 8 月 17 日《关于核准工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1123 号文）核准募集，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。

工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金自 2012 年 9 月 3 日至 2012 年 10 月 19 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 10 月 25 日起正式生效。

经中国证监会 2018 年 1 月 11 日《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的批复》，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。

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 日召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》，内容包括工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更基金类别、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、收益分配原则、费率水平以及修订基金合同等，并同意将转型后基金更名为“工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自 2018 年 4 月 17 日起，《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》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）生效，原《工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据市场环境变化，为更好地保护基金份额持有人的利益，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》和《基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。

本基金于 2023 年 12 月 6 日起至 2024 年 1 月 5 日以通讯方式召开工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于终止工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。本基金最后运作日为 2024 年 1 月

9日，自2024年1月10日起进入清算期。

本基金自2024年1月10日起进入清算期，由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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

§ 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
§1.1 重要提示.....	2
§1.2 目录.....	4
§2 基金产品概况	5
§3 基金运作情况	6
§4 财务会计报告（经审计）	7
§5 清盘事项说明	8
§5.1 清算费用.....	8
§5.2 资产处置情况.....	8
§5.3 负债清偿情况.....	8
§5.4 清算期间的剩余资产分配情况.....	9
§5.5 基金财产清算报告的告知安排.....	10
§6 备查文件目录	10
§6.1 备查文件目录.....	10
§6.2 存放地点.....	10
§6.3 查阅方式.....	10

§ 2 基金产品概况

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	京津冀
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
最后运作日（2024年1月9日）基金份额总额	13,657,495.58份
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。
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

§ 3 基金运作情况

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）由工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更而来。工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金经中国证监会 2012 年 8 月 17 日《关于核准工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1123 号文）核准募集，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。

工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金自 2012 年 9 月 3 日至 2012 年 10 月 19 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 10 月 25 日起正式生效。

经中国证监会 2018 年 1 月 11 日《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的批复》，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。

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 日召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更相关事项的议案》，内容包括工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金变更基金类别、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、收益分配原则、费率水平以及修订基金合同等，并同意将转型后基金更名为“工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自 2018 年 4 月 17 日起，《基金合同》生效，原《工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据市场环境变化，为更好地保护基金份额持有人的利益，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》和《基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。

本基金于 2023 年 12 月 6 日起至 2024 年 1 月 5 日以通讯方式召开工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于终止工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。本基金最后运作日为 2024 年 1 月 9 日，自 2024 年 1 月 10 日起进入清算期。

§ 4 财务会计报告（经审计）

基金最后运作日资产负债表

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：2024年1月9日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2024年1月9日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	794,099.88
结算备付金	2.09
存出保证金	715.94
交易性金融资产	10,771,436.58
其中：股票投资	10,735,795.18
债券投资	35,641.40
资产总计	11,566,254.49
负债和净资产	本期末 2024年1月9日（基金最后运作日）
负债：	
应付赎回款	105,062.05
应付管理人报酬	8,082.60
应付托管费	1,616.55
应付销售服务费	107.93
其他负债	132,167.18
负债合计	247,036.31
净资产：	
实收基金	9,642,712.41
未分配利润	1,676,505.77
净资产合计	11,319,218.18
负债和净资产总计	11,566,254.49

注：1、报告截止日2024年1月9日（基金最后运作日），基金份额净值A类为人民币0.8299元，C类为人民币0.8217元，基金份额总额13,657,495.58份。

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§ 5 清盘事项说明

自 2024 年 1 月 10 日至 2024 年 1 月 26 日止为清算期间。基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

§ 5.1 清算费用

按照《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

§ 5.2 资产处置情况

本基金最后运作日持有的股票投资估值金额为人民币 10,735,795.18 元，已于清算期间全部卖出。

本基金最后运作日持有的债券投资估值金额为人民币 35,641.40 元，已于清算期间全部卖出。

本基金最后运作日结算备付金余额全部为备付金利息人民币 2.09 元，该部分利息于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该款项。

本基金最后运作日存出保证金为人民币 715.94 元，其中上海存出保证金人民币 294.40 元，应计存出保证金利息人民币 0.33 元；深圳存出保证金人民币 420.94 元，应计存出保证金利息人民币 0.27 元。上述款项中存出保证金将按照结算规则划回托管户，应计存出保证金利息合计人民币 0.60 元，于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付上述款项。

§ 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款为人民币 105,062.05 元，其中 A 类应付赎回款为人民币 79,406.88 元，C 类应付赎回款为人民币 25,655.17 元，该款项已于 2024 年 1 月 10 日、2024 年 1 月 11 日支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 8,082.60 元，该款项将于清算期结束之后支付。

本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,616.55 元，该款项将于清算期结束之后支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 107.93 元，该款项将于清算期结束之后支付。

本基金最后运作日其他负债为人民币 132,167.18 元,为应付赎回费、应付交易费用、审计费、律师费、标的指数许可使用费及公证费。其中应付交易费用为人民币 2,088.91 元,应付审计费为人民币 45,000.00 元,应付标的指数许可使用费为人民币 54,945.05 元,以上款项预计将于收到付款通知书及发票起五日内支付;应付赎回费为人民币 133.22 元,已于 2024 年 1 月 10 日、2024 年 1 月 11 日支付;应付公证费为人民币 10,000.00 元,应付律师费为人民币 20,000.00 元,上述款项已于 2024 年 1 月 23 日支付。

§ 5.4 清算期间的剩余资产分配情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 1 月 9 日基金净资产	11,319,218.18
加:清算期间(2024-1-10 至 2024-1-26)收入	
利息收入(注 1)	1,603.08
变现损益(注 2)	-3,265,162.89
公允价值变动损益	3,247,464.43
其他收入(注 3)	440.67
减:清算期间(2024-1-10 至 2024-1-26)费用	
其他费用(注 4)	-17,725.00
减:清算期间(2024-1-10 至 2024-1-26)基金赎回产生的基金净值变动数(注 5)	1,264,395.96
二、2024 年 1 月 26 日(清算报告出具日)基金净资产(注 6)	10,056,892.51

注:

1、利息收入系以当前使用的利率计提的自 2024 年 1 月 10 日至 2024 年 1 月 26 日止银行存款、结算备付金、存出保证金的利息。

2、变现损益系清算期间处置交易性股票投资和交易性债券投资产生的差价收入扣减交易费用所致。

3、其他收入系清算期间赎回费收入。

4、其他费用系审计费用的减免金额和银行汇款费所致。

5、清算期间基金赎回产生的基金净值变动数为 2024 年 1 月 10 日赎回确认产生的基金净值变动数。

6、资产处置后,于 2024 年 1 月 26 日本基金剩余财产为人民币 10,056,892.51 元,根据本基金的基金合同约定,依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分

配。

2024年1月27日至资产支付日前一日产生的银行存款、结算备付金及存出保证金的利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金期间孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

§ 5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报北京证监局备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件目录

§ 6.1 备查文件目录

- 1、《工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）清算审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）清算报告〉的法律意见》

§ 6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

§ 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF）基金财产清算小组

2024年1月26日