工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银新生代消费混合
交易代码	005526
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月13日
报告期末基金份额总额	1,238,081,483.75份
投资目标	本基金在合理配置股票与债券等资产的基础上,通过重点选择与新生代消费相关的优质上市公司进行投资,在风险可控的前提下追求最大化的投资收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪宏观经济环境变化,根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平,在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略,将基金资产在各类型证券上进行灵活配置,在市场上涨阶段中,增加权益类资产配置比例;在市场下行周期中,增加固定收益类资产配置比例,最终力求实现基金资产组合收益的最大化,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。在股票投资方面,在新生代消费主题界定的基础上,本基金将通过定性分析和定量分析相结合的办法,重点关注在相应领域内具备核心竞争优势,形成技术壁垒的投资标的,通过进一步对估值水平的评估,最终选择优质且估值合理的上市公司的股票进行投资。
业绩比较基准	30%×中证全指主要消费指数收益率+30%×中证TMT产业主题指数收益率+40%×中债综合财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,预期收益和风险水平低于股票型基金、高于债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-24,589,704.81
2.本期利润	-32,460,234.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0239
4.期末基金资产净值	1,192,730,101.44
5.期末基金份额净值	0.9634

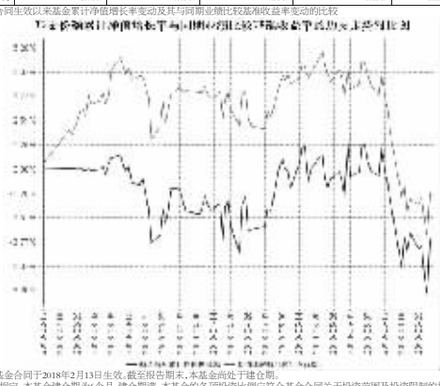
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-2.70%	1.19%	-4.99%	0.89%	2.29%	0.30%

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



注:1、本基金基金合同于2018年2月13日生效,截至报告期末,本基金尚处于建仓期。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月,建仓期满,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于本基金界定的新生代消费主题相关的证券不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚芳	本基金的基金经理	2018年2月13日	-	11	曾在嘉实基金担任股票交易员;2011年加入工银瑞信,现任研究部大消费研究团队负责人、基金经理。2015年12月30日至今,担任工银瑞信文体产业股票型基金基金经理;2018年2月13日至今,担任工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金建仓期为6个月,建仓期满,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于本基金界定的新生代消费主题相关的证券不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金基金份额净值增长率为-2.70%,业绩比较基准收益率为-4.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	899,746,279.62	67.61
	其中:股票	899,746,279.62	67.61
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	100,000,000.00	7.51
	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	329,790,065.96	24.78
8	其他资产	1,307,711.60	0.10
9	合计	1,330,844,057.18	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	580,508,498.22	48.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,037,946.65	4.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	69,682,487.37	5.84
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	37,076,009.74	3.11
J	金融业	12,647,635.00	1.06
K	房地产业	65,182,165.15	5.46
L	租赁和商务服务业	57,004,151.35	4.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	22,526,160.00	1.89
S	综合	-	-
	合计	899,746,279.62	75.44

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600271	航天信息	2,361,622	59,678,187.94	5.00
2	000651	格力电器	1,262,206	59,513,012.90	4.99
3	600298	安琪酵母	1,340,368	47,824,330.24	4.01
4	600887	伊利股份	1,673,279	46,684,484.10	3.91
5	000895	双汇发展	1,418,554	37,464,011.14	3.14
6	600519	贵州茅台	47,841	34,993,777.86	2.93
7	002027	分众传媒	3,543,840	33,914,548.80	2.84
8	300567	精测电子	406,468	32,354,852.80	2.71
9	600885	宏发股份	1,075,910	32,191,227.20	2.70
10	600011	华能国际	4,814,858	30,622,496.88	2.57

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的投资决策程序说明:

分众传媒

本报告期,本基金持有分众传媒,其发行主体因部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整,2015年年报信息披露存在遗漏,未在股东大会授权范围内购买银行理财产品等违规行为,被中国证监会广东监管局采取出具警示函的监管措施。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响,投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	859,848.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,833.12
5	应收申购款	386,030.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,307,711.60

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,490,386,634.07
报告期期间基金总申购份额	11,029,873.06
减:报告期期间基金总赎回份额	263,335,023.38
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,238,081,483.75

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。

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

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银创业板ETF联接
交易代码	005390
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月21日
报告期末基金份额总额	244,587,673.59份
投资目标	主要投资本基金目标ETF,采用指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金的主要资产将投资于目标ETF份额,该部分资产占基金资产净值的比例不低于90%,本基金不参与目标ETF的投资管理,根据需要,本基金可以投资于标的指数成份股票、备选成份股票,以及非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,其目的是为了使得本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金以工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金为主要投资品种,为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券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	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	工银创业板ETF联接A	工银创业板ETF联接C
下属分级基金的交易代码	005390	005391
报告期末下属分级基金的份额总额	40,815,680.38份	203,771,993.21份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159958
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年12月25日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2018年1月19日
基金管理人名称	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	-
投资策略	-
业绩比较基准	创业板指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	工银创业板ETF联接A	工银创业板ETF联接C
1.本期已实现收益	291,394.96	131,869.69
2.本期利润	-4,085,888.35	-11,035,737.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0798	-0.0847
4.期末基金资产净值	36,132,433.69	179,583,495.25
5.期末基金份额净值	0.8853	0.8813

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、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

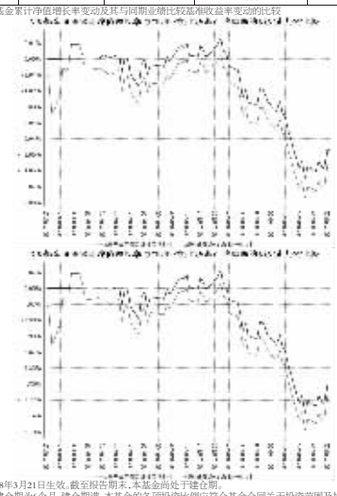
工银创业板ETF联接A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-11.53%	1.41%	-14.71%	1.55%	3.18%	-0.14%

工银创业板ETF联接C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-11.92%	1.41%	-14.71%	1.55%	2.79%	-0.14%

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



注:1、本基金基金合同于2018年3月21日生效,截至报告期末,本基金尚处于建仓期。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月,建仓期满,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定;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%,每个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。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵栩	指数投资中心投资部副总监,本基金的基金经理	2018年3月21日	-	10	2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部金融工程分析师、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发起基金基金经理。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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 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)标的指数成份股调整等。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银创业板ETF联接A份额净值增长率为-11.53%,工银创业板ETF联接C份额净值增长率为-11.92%,业绩比较基准收益率为-14.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	149,680,872.10	66.90
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	19,742,026.35	8.82
8	其他资产	54,320,815.53	24.28
9	合计	223,743,713.98	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 。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	28,417.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,134.64
5	应收申购款	4,119.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,671.68

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.1 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动(钟型后)

单位:份

项目	工银创业板ETF联接A	工银创业板ETF联接C
报告期期初基金份额总额	192,439,334.31	341,502,119.06
报告期期间基金总申购份额	14,017,413.08	160,495,305.50
减:报告期期间基金总赎回份额	165,641,067.01	298,225,431.35
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	40,815,680.38	203,771,993.21

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	20180401-20180630	8,311,859.24	2,812,608.62	0.00		11,124,467.86	34.32%
	2	20180401-20180426	10.54	16,983,627.60	16,983,638.14		0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品持有风险								
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。								

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予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募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。

工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF)

2018 第二季度 报告

2018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
报告送出日期:二〇一八年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

报工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金报告期自2018年4月1日起至2018年4月17日止。工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金报告期自2018年4月17日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	工银京津冀指数
场内简称	京津冀
交易代码	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
报告期末基金份额总额	32,417,119.54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。通过严格分散投资风险,为不同价格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	本基金采用完全复制策略,跟踪标的指数的成份股和成份股的权重,按照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,争取尽可能地追踪标的指数的表现。
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

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	32,410,118.04份	7,001.50份

转型前:

基金简称	工银深证100指数分级
场内简称	100分级
交易代码	164814
基金运作方式	契约型,开放式
基金合同生效日	2014年10月17日
报告期末基金份额总额	50,960,178.94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。通过严格分散投资风险,为不同价格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	本基金采用完全复制策略,跟踪标的指数成份股和成份股的权重,按照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,争取尽可能地追踪标的指数的表现。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+同期银行存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其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,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。深证100A份额具有较高杠铃型风险收益特征。深证100B份额具有较高、较低两种收益特征。
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

下属分级基金的基金简称	深证100A	深证100B	100分级
下属分级基金的交易代码	150012	150013	164814
报告期末下属分级基金的份额总额	5,350,826.00份	8,432,217.00份	37,177,135.94份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月17日 - 2018年6月30日)	
	工银京津冀指数A	工银京津冀指数C
1.本期已实现收益	-114,822.32	-8.60
2.本期利润	-44,323.35	-11.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0013	-0.0024
4.期末基金资产净值	32,398,260.54	6,989.60
5.期末基金份额净值	0.9996	0.9983

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