

工银瑞信增强收益债券型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:二〇一八年八月十四日

§ 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。本半年度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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年月22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。

本半年度报告摘要节选自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:工银瑞信增强收益债券基金
基金简称:工银瑞信增强收益
基金代码:400105
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2007年1月1日
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告期末基金资产总额:1,367,377,407.84份

基金合同存续期间:不定期

下属分级基金的基金名称:工银瑞信增强收益债券A
工银瑞信增强收益债券B

下属分级基金的交易代码:400105
400006

下属分级基金的基金资产总额:400105
—

下属分级基金的基金资产总份额:400105
—

报告期末基金资产净值:1,010,767,743.04份
338,619,744.00份

2.2 基金产品说明

投资目标:在严格控制风险的前提下，力争在合理的风险收益比上取得超越业绩基准的收益。

投资策略:本基金在严格控制风险的前提下，通过精选具有投资价值的债券品种，结合对宏观经济、利率、债券市场、资金面等的综合分析，制定合理的资产配置策略，并在此基础上，通过积极的债券投资管理，力争在合理的风险收益比上取得超越业绩基准的收益。

业绩比较基准:中债综合指数(财富)收益率

风险特征:本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。

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 中国建设银行股份有限公司

姓名 朱德勇 田国伟

信息披露负责 人 联系电话 400-811-0090 010-67969996

电子邮箱 customernservice@icbc.com.cn tianying.1@icbc.com

客户服务电话 400-811-0090 010-67969996

传真 010-66631958 010-66727983

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址:www.jzxxcn.com

基金半年度报告备置地:基金管理人和基金托管人的住所

3.1 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

基金级别 工银瑞信增强收益债券A 工银瑞信增强收益债券B

报告期自2018年1月1日—2018年6月30日

报告期初基金资产净值:970,077,665.00

本期已实现收益:—16,459,403.5

已实现基金利润:—0.0130

本期利润:—1.31%

3.1.2 期末数据和指标

报告期自2018年6月30日

报告期末基金资产净值:0.0090

报告期末基金资产净值:1,079,314,122.19

报告期末基金资产净值:367,764,986.39

报告期末基金资产净值:1,0694

报告期末基金资产净值:1.0694

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，费用影响会导致实际收益水平低于净值表现。

2. 本期的利润收益是扣减基金期间的应收利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额，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. 所列数据截至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易日的交易日。

4. 本基金基金合同生效日为2007年5月11日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银瑞信增强收益债券A

阶段 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -0.40% 0.24% 0.62% 0.06% -102% 0.18%

过去二个月 -0.56% 0.24% 0.95% 0.10% -250% 0.14%

过去三个月 -131% 0.26% 3.87% 0.08% -618% 0.17%

过去一年 -0.74% 0.20% 4.25% 0.06% -499% 0.14%

过去三年 350% 11.24% 11.24% 0.08% -774% 0.09%

自基金合同生效起至今 100.72% 0.31% 54.79% 0.08% 51.94% 0.23%

工银瑞信增强收益债券B

阶段 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率(%) 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -0.43% 0.24% 0.62% 0.06% -102% 0.18%

过去二个月 -0.60% 0.24% 0.95% 0.10% -261% 0.14%

过去三个月 -151% 0.26% 3.87% 0.08% -638% 0.17%

过去一年 -1.13% 0.20% 4.25% 0.06% -520% 0.14%

过去三年 241% 11.24% 11.24% 0.08% -833% 0.09%

自基金合同生效起至今 241% 0.31% 54.79% 0.08% 51.94% 0.23%

6.6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:工银瑞信增强收益债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产 附注号 本期末 2018年6月30日 上年度末 2017年12月31日

资产: 银行存款 31,434,790.46 68,304,546.05

结算备金 11,105,706.03 12,020,702.25

卖出回购金融资产 29,124.18 33,794.44

交易性金融资产 1,740,201,177.02 2,244,311,814.64

其中:股票投资 89,708,227.65 97,947,406.40

债券投资 1,650,402,949.47 2,146,564,406.24

贵金属投资 — —

衍生金融资产 — —

买入返售金融资产 17,491,426.74

应收利息 30,469,036.02 37,737,974.50

应收股利 149,460.45 26,797.44

应收申购款 439,927.48 1,096,081.93

应付赎回款 746,471.88 406,496.86

应付托管费 248,823.09 208,406.06

应付交易费用 3,982.70 5,276.63

应付税费 119,220.62 —

应付利息 -36,066.64 631,636.13

应付福利费 — —

应付违约金 6,688,026.96 6,676,556.90

应付手续费 376,310,184.00 626,101,106.97

所有者权益: 附注号 本期末 2018年6月30日 上年度末 2017年12月31日

负债: 银行存款 31,434,790.46 68,304,546.05

结算备金 11,105,706.03 12,020,702.25

卖出回购金融资产 29,124.18 33,794.44

交易性金融资产 1,740,201,177.02 2,244,311,814.64

其中:股票投资 89,708,227.65 97,947,406.40

债券投资 1,650,402,949.47 2,146,564,406.24

贵金属投资 — —

衍生金融资产 — —

买入返售金融资产 17,491,426.74 23,722.73

应收利息 4,883,361.23 7,043,391.45

应收股利 377,450.27 1,342,700.00

应收申购款 15,506,706.67 -8,419,794.32

应付赎回款 -21,103,382.29 -36,549,699.66

应付手续费 31,622.25 4,660,000.00

应付交易费用 4,004,20.00 2,000.00

应付税费 1,000,000.00 1,000,000.00

应付利息 33,848.60 120,810.09

应付股利 17,439,769.28 16,012,975.63

应付申购款 4,663,301.23 7,043,391.45

应付赎回款 1,627,787.13 2,184,700.00

应付手续费 377,450.27 1,342,700.00

应付交易费用 31,622.25 4,660,000.00

应付税费 4,004,20.00 2,000.00

应付利息 9,796,171.36 5,297,722.73

应付股利 100,064.20 2,000.00

应付申购款 226,112.94 233,722.54

应付赎回款 -20,796,068.17 -7,246,146.96

应付手续费 -20,796,068.17 -7,246,146.96

应付利息 -20,796,068.17 -7,246,146.96

应付股利 -20,796,068.17 -7,246,146.96

应付申购款 1,627,787.13 2,184,700.00

应付赎回款 3,477,450.27 4,660,000.00

应付手续费 3,477,450.27 4,660,000.00