

工银瑞信中债-国债(7-10年)总指数证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年八月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、经理及其他人员不存在虚假记载、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，并报监管机构。

基金管理人和中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8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，诚信经营，勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本半年度报告摘要自半年度报告正式文本生效之日起六周内披露。

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2018年06月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银瑞信中债-国债(7-10年)指数
基金代码	000405
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月4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
报告期末基金份额总额	64,990,426.94份
基金类别	债券型
下一级基金的基金简称	工银瑞信中债-国债(7-10年)指数A
下一级基金的交易代码	000405
报告期末下一级基金的总资产	64,477,180.01份
报告期末下一级基金的总负债	10,513,240.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过有效投资，通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，实现对标的指数的被动跟踪。
投资策略	本基金将被动地采用多样化的被动化投资方式执行投资，在综合考虑宏观经济、行业、利率、信用等宏观因素的基础上，通过定期调整资产配置比例和择时调整投资策略来实现对标的指数的跟踪。同时，通过定期调整资产配置比例和择时调整投资策略来实现对标的指数的跟踪。
业绩比较基准	中债-国债(7-10年)指数收益率
风险收益特征	风险收益特征：低风险、低收益

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	中国农业银行股份有限公司
性别	男	男
信息披露负责人	朱鹤娟	胡静
办公地址	400-811-9900	010-66990009
电子邮箱	customerservice@icbcfund.com	icbcfund@abcabc.com
客户服务电话	400-811-9900	96699
传真	010-66653196	010-68121816

2.4 信息披露方式

基金年度报告披露的管理人互联网网址	www.icbcfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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

基金资产净值单位:人民币元

基金期初	工银瑞信中债-国债(7-10年)指数A	工银瑞信中债-国债(7-10年)指数C
报告期初:2018年1月1日 - 2018年6月30日	报告期初:2018年1月1日 - 2018年6月30日	报告期初:2018年1月1日 - 2018年6月30日
本期实现收益	-2,145,236.00	97,096.22
已实现的基金期间利润	0.0389	0.0067
本期基金份额净值	3.07%	3.06%
3.1.2 期末可供分配利润	报告期初:2018年1月1日	-0.0064
3.1.3 期末可供分配基金份额总额	66,377,103.26	10,676,036.09
3.1.4 期末基金份额总额	10,106.00	1,010.00

注:1.上表基金业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)

扣减相关费用后的余额,期间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。

4.基金合同生效日为2017年1月4日。

3.2 基金的净值表现

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

工银瑞信中债-国债(7-10年)指数A

阶段	份额增长(%)	份额增长(%)	业绩比较基准增长(%)	业绩比较基准增长(%)	(1) - (3)	(2) - (4)
过去一个月	1.17%	0.17%	1.21%	0.16%	-0.04%	0.01%
过去二个月	2.70%	0.20%	3.13%	0.20%	-0.43%	0.00%
过去三个月	3.07%	0.16%	4.06%	0.15%	-1.00%	0.01%
过去六个月	2.72%	0.16%	4.16%	0.14%	-1.46%	0.01%
过去一年	2.99%	0.14%	4.18%	0.14%	-1.20%	0.00%
自基金合同生效至今	14.06%	0.14%	1.96%	0.16%	-0.30%	-0.01%

工银瑞信中债-国债(7-10年)指数C

5. 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守信义情况的说明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同,托管协议的约定,对本基金基金管理人-工银瑞信基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金持有人利益的行为。

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

本托管人认为,工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回的核算、基金费用开支及利润分配等方面上,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等的真实、准确和完整发表意见

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同,托管协议的约定,对本基金基金管理人-工银瑞信基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金持有人利益的行为。

5.4 托管人对本年度报告中财务信息等的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回的核算、基金费用开支及利润分配等方面上,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.5 托管人对本年度报告中财务信息等的真实、准确和完整发表意见

本报告期无。

6.1 资产负债表

会计主体:工银瑞信中债-国债(7-10年)总指数证券投资基金

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
货币资金		3,198,623.20		27,521.46	51,034.00
交易性金融资产		300,000.00		300,000.00	300,000.00
可供出售金融资产	63,813,061.20	50,324,930.00			
其中:股票投资		50,324,930.00			
基金投资		63,813,061.20	50,324,930.00		
债券投资		63,813,061.20	50,324,930.00		
衍生金融资产		0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	649,374.97	471,538.49			
应收股利		47,222.99			
应收申购款		70,050.00			
应收罚息		0.00	0.00	0.00	0.00
溢短款		0.00	0.00	0.00	0.00
其他应收款		2,000,000.00			
应收股利		0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息		0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款		0.00	0.00	0.00	0.00
应收罚息		0.00	0.00	0.00	0.00
溢短款		0.00	0.00	0.00	0.00
其他应收款		2,000,000.00			
应付利息	111,115	105,623.26			
应付股利		11,085.00	10,632.26		
应付手续费		3,739.08	3,402.20		
应付交易费用		166,002	133.00		
应付申购款		0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款		100,763,729	2,790,322.36		
应付罚息		0.00	0.00	0.00	0.00
溢短款		0.00	0.00	0.00	0.00
其他应付款		84,889.00	136,546.63		
应付股利		100,763,729	2,790,322.36		
应付申购款		0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款		100,763,729	2,790,322.36		
应付罚息		0.00	0.00	0.00	0.00
溢短款		0.00	0.00	0.00	0.00
其他应付款		84,889.00	136,546.63		
应付股利		1			