

工银瑞信双利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:交通银行股份有限公司
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、监事和高级管理人员在报告期内不存在被立案调查、行政处罚或重大损害投资者利益的重大诉讼、仲裁情况,并由董事长签字。

本报告期内未出现影响基金净值的因素,基金管理人对基金投资决策及运作管理的内部控制制度不存在重大缺陷。

基金管理人承诺以诚实守信、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。投资人投资,在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要披露自年度报告正文,投资人欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

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 工银瑞信双利债券型证券投资基金

基金简称 工银瑞信双利债券

基金代码 400111

基金合同生效日 2010年9月16日

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

报告期末基金资产总额 2,080,500,504.95

基金合同约定的基金存续期间 不定期

基金募集期间的费用情况 无

下级基金的基金简称:工银瑞信双利债券A 工银瑞信双利债券B

下级基金的交易代码: 400111 406111

报告期末下属分级基金的份额 2,004,314,707.01份 176,193,717.54份

2.2 基金产品信息

报告目标 在兼顾风险和保持资产流动性的情况下,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求长期稳定的资本增值。

投资策略 通过分析宏观经济形势、利率走势、信用环境、行业景气度、公司基本面等,精选具有较好投资价值的债券品种,构建合理的资产配置组合。

业绩比较基准 基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×30%+一年期定期存款利率(税后)×70%

风险收益特征 风险收益特征属中低风险品种,适合风险承受能力较低的投资者。

2.3 基金管理人员和托管人

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 交通银行股份有限公司

姓名 朱崇伟 黄志伟

联系电话 040-811-00009 06669

电子邮件 电子邮箱 czystm@icbc.com.cn fzj@icbc.com.cn

传真 010-66930198 021-62901216

2.4 信息披露方式

载披露基金年度报告的管理人互联网网址 www.icbcfund.com

基金半年度报告备查地点 基金管理人和基金托管人的住所

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金利润 工银瑞信双利债券 A 工银瑞信双利债券 B

报告期利润 2010年1月1日至2010年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

报告期利润 119,481,789.66 8,290,206.16

本期已实现收益 200,287,035.62 14,150,965.27

加权平均基金份额本期利润 0.0793 0.0749

本期基金份额变动比例 4.71% 4.00%

3.2 主要财务指标

报告期利润/报告期初基金份额总额 ×100% 报告期/2010年6月31日

本期末可供分配利润/报告期初基金份额总额 ×100% 6,101,444,000.03 303,097,700.11

注:上表主要财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于上述数字。

3.3 利润数据列示:报告期最后一日,无论当日是否为开放日或交易所的交易日。

3.4 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银瑞信双利债券A 近一月 0.02% 0.02% 0.00% 0.00% -0.04% 0.03%

近二个月 0.02% 0.08% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00% 0.00%

近三个月 1.00% 0.16% 1.00% 0.10% -0.02% 0.00%

近六个月 1.00% 0.16% 1.00% 0.10% -0.02% 0.00%

近九个月 1.00% 0.16% 1.00% 0.10% -0.02% 0.00%

近一年 1.00% 0.16% 1.00% 0.10% -0.02% 0.00%

近二年 3.56% 0.16% 4.25% 0.07% -0.07% -0.02%

近三年 10.12% 0.28% 11.24% 0.08% 0.07% 0.14%

近五年 77.70% 0.26% 35.20% 0.09% 0.09% 0.16%

近十年 72.00% 0.26% 36.30% 0.09% 0.09% 0.16%

3.5 其他指标

注:本基金合同生效以来基金总份额累计净值增长率为10.16%,同期业绩比较基准收益率为1.00%。

3.6 资产负债情况

报告期末资产情况:货币市场基金 1,000,439,000.92

报告期初资产情况:货币市场基金 1,000,439,000.92

报告期资产总计情况:货币市场基金 1,000,439,000.92

报告期负债情况:货币市场基金 1,000,439,000.92

报告期末所有者权益情况:货币市场基金 1,000,439,000.92

报告期所有者权益变动情况:货币市场基金 1,000,439,000.92

注:本基金合同生效以来基金总份额累计净值增长率为10.16%,同期业绩比较基准收益率为1.00%。

3.7 表现数据

注:本基金合同生效以来基金总份额累计净值增长率为10.16%。

3.8 基金投资组合报告

报告期投资组合变动情况:股票 0.00%

报告期投资组合变动情况:债券 100.00%

报告期投资组合变动情况:现金类金融资产 100.00%

报告期投资组合变动情况:其他 0.00%

报告期投资组合变动情况:衍生工具 0.00%

报告期投资组合变动情况:权证 0.00%

报告期投资组合变动情况:贵金属 0.00%

报告期投资组合变动情况:其他投资 0.00%

报告期投资组合变动情况:其他 0.00%

报告期投资组合