

# 国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金

## 2018年半年度报告摘要

2018年 6月 30日  
基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

### 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金份额持有人应当遵守基金合同，不得损害基金持有人的合法权益。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照法律法规及基金合同的约定，履行各自应尽的义务。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，披露相关信息。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，披露相关信息。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，披露相关信息。

本报告告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日。

### 2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金简称	国投瑞银一年定期开放债券 A
基金代码	000237

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

### 1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金份额持有人应当遵守基金合同，不得损害基金持有人的合法权益。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，履行各自应尽的义务。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，披露相关信息。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，披露相关信息。  
基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等主体应当按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的约定，披露相关信息。

本报告告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日。

**2.2 基金产品说明**

投资目标	本基金以一年为一个运作周期,每一年开放一次,其余时间不接受申购和赎回。在封闭期内,本基金不接受申购和赎回。		
投资策略	本基金将综合运用久期配置、期限错配、杠杆放大、资产配置、利率预期、信用分析、个券选择等策略,通过主动管理,力争实现基金资产的长期稳定增值。		
业绩比较基准	中证综合债指数收益率*65%+一年期定期存款利率(税后)*35%		
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币市场基金,属于较低风险品种。		
2.3 基金管理人和基金托管人	基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司 基金托管人：中国银行股份有限公司		
名称	国投瑞银基金管理有限公司		
住所	中国北京市朝阳区		
法定代表人	王彬洪		
信息披露负责人	陈颖		
客户服务电话	400-888-6868 service@gtjrfund.com 010-66594000		
网站	http://www.gtjrfund.com		
基金客户服务电话	深圳市福田区益田路 4029 号中行置地中心 45 楼		
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			
金额单位：人民币元			
3.1.1 利润数据和指标			
报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债券 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
本期利润	3,621,382.10		
本利利润	4,307,748.22		
加权平均基金份额本期利润	0.0341		
期末基金资产净值增长率	3.34%		
3.1.2 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债券 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
可供分配利润	0.0001		
期末基金资产净值	1085		
注：1. 本期已实现收益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。 2. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。 3. 以上所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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平将低于上述数字。 3.2 基金净值表现			
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			
国投瑞银一年定期开放债 A			
报告期：2013年 8月 21日至 2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A			
图示			
国投瑞银一年定期开放债 C			
图示			
注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。			
4 管理人报告			
4.1 基金管理人及其基金经理的情况			
国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于 2002 年 6 月 13 日成立，注册资本 1 亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到 49% 的外商独资基金管理公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效风险管理及控制架构，以“诚信、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止 2018 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 73 只基金，已建立起覆盖高中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自 2008 年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运用管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII 等创新品种，在境外资产管理业务方面，公司自 2006 年开始为 QFII 信托计划提供投资咨询服务，具有丰富经验，并于 2007 年获得 QDII 资格。			
4.2 基金经理（或基金经理小组）及其基金经理助理的简介			
姓名	担任本基金基金经理(助理)期间	从事行业时间	任期
王彬洪	2010-7-15 至今	金融、证券投资	10 年
孙晓东	2016-5-17 至今	金融、证券投资	9 年
李进达	2017-04-24 至今	金融、证券投资	11 年
注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。			
4.3 管理人对报告期内基金运作总体评价			
报告期内，本基金在严格遵守基金合同的基础上，根据基金合同的约定，结合当前宏观经济环境、资金面情况、利率走势、信用利差等因素，通过久期配置、期限错配、杠杆放大、资产配置、利率预期、信用分析、个券选择等策略，力争实现基金资产的长期稳定增值。			
4.4 管理人对宏观经济、证券市场及基金市场的展望			
本基金将继续坚持“精选债券、严控风险”的投资理念，通过久期配置、期限错配、杠杆放大、资产配置、利率预期、信用分析、个券选择等策略，力争实现基金资产的长期稳定增值。			
4.5 管理人对基金未来业绩的展望			
本基金将继续坚持“精选债券、严控风险”的投资理念，通过久期配置、期限错配、杠杆放大、资产配置、利率预期、信用分析、个券选择等策略，力争实现基金资产的长期稳定增值。			
4.6 管理人对报告期内基金估值政策和程序的说明			
本基金的估值政策和程序遵循《基金合同》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金估值指引》、《公开募集开放式证券投资基金销售机构公平销售行为规范》等法律法规及基金合同的有关规定。			
4.7 管理人对报告期内基金利润分配政策的说明			
本基金的利润分配政策参见《基金合同》第十五部分“基金的收益与分配”。			
4.8 管理人对基金未来进行分配的说明			
本基金在满足基金分红条件的情况下，将根据基金合同的约定，适时向基金份额持有人进行分配。			
4.9 管理人对基金资产估值方法的说明			
本基金的估值方法参见《基金合同》第十五部分“基金的估值”。			
5 报告期内基金主要会计数据和财务指标			
5.1 报告期内基金主要会计数据			
金额单位：人民币元			
5.1.1 利润数据			
报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
本期利润	3,621,382.10		
本利利润	4,307,748.22		
加权平均基金份额本期利润	0.0341		
期末基金资产净值增长率	3.34%		
5.1.2 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.2 资产负债表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.3 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.4 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.5 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.6 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.7 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.8 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者权益	-	-	
5.9 资产负债表和损益表			
报告期：2018年 6月 30日			
国投瑞银一年定期开放债 A	国投瑞银一年定期开放债券 C		
资产			
2018年 6月 30日	2018年 12月 31日		
资产总计	588,504,111	396,396,000	
负债总计	4,676,473,45	770,050,638	
所有者权益	240,055,285,1	212,831,402,4	
资产总计	240,055,285,1	212,831,402,4	
负债总计	-	-	
所有者			