

工银瑞信中债-国债(7-10年)总指数证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:二〇一九年三月三十日

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。

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2019年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表、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基金更新。

本年度报告摘要摘自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, type, and dates.

2.2 基金产品说明

投资目标:运用指数化投资,通过控制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。

投资策略:本基金将对标的指数采用抽样复制法动态优化的方式进行跟踪,在综合考虑跟踪效果、跟踪误差、流动性、可复制性等影响因素的基础上,构建投资组合以实现紧密跟踪标的指数表现,并控制跟踪误差。

业绩比较基准:中债-国债(7-10年)总指数收益率。

风险收益特征:本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Name and Position. Lists the fund manager and custodian.

2.4 信息披露方式

Table with 2 columns: Item and Value. Lists website and contact info.

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.2 主要会计数据和净值指标

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial data for the period.

3.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics.

3.4 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item and Value. Shows benchmark data.

3.5 基金费用

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fee schedule.

3.6 基金收益分配

Table with 2 columns: Item and Value. Shows distribution details.

3.7 基金资产净值及基金份额净值

Table with 2 columns: Item and Value. Shows NAV data.

3.8 基金持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: Item and Value. Shows holder statistics.

3.9 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows management info.

3.10 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item and Value. Shows benchmark data.

3.11 基金费用

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fee schedule.

3.12 基金收益分配

Table with 2 columns: Item and Value. Shows distribution details.

3.13 基金资产净值及基金份额净值

Table with 2 columns: Item and Value. Shows NAV data.

3.14 基金持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: Item and Value. Shows holder statistics.

3.15 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows management info.

3.16 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item and Value. Shows benchmark data.

3.17 基金费用

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fee schedule.

3.18 基金收益分配

Table with 2 columns: Item and Value. Shows distribution details.

3.19 基金资产净值及基金份额净值

Table with 2 columns: Item and Value. Shows NAV data.

3.20 基金持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: Item and Value. Shows holder statistics.

3.21 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows management info.

3.22 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item and Value. Shows benchmark data.

3.23 基金费用

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fee schedule.

3.24 基金收益分配

Table with 2 columns: Item and Value. Shows distribution details.

3.25 基金资产净值及基金份额净值

Table with 2 columns: Item and Value. Shows NAV data.

3.26 基金持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: Item and Value. Shows holder statistics.

3.27 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows management info.

3.28 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item and Value. Shows benchmark data.

3.29 基金费用

Table with 2 columns: Item and Value. Shows fee schedule.

3.30 基金收益分配

Table with 2 columns: Item and Value. Shows distribution details.

3.31 基金资产净值及基金份额净值

Table with 2 columns: Item and Value. Shows NAV data.

3.32 基金持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: Item and Value. Shows holder statistics.

3.33 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows management info.

3.34 基金业绩比较基准

Table with 2 columns: Item and Value. Shows benchmark data.

7.1 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12月31日

单位:人民币元

Balance Sheet table with columns: Asset, Liability, and Total. Shows financial data for 2018-12-31 and 2017-12-31.

7.2 利润表

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12月31日

单位:人民币元

Income Statement table with columns: Item, 2018, 2017. Shows income and expenses for 2018 and 2017.

7.3 所有者权益变动表

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12月31日

单位:人民币元

Equity Movement Statement table with columns: Item, 2018, 2017. Shows changes in equity components.

7.4 关联方关系

关联方:工银瑞信基金管理有限公司

关联方:中国银行股份有限公司

关联方:工银瑞信(香港)资产管理有限公司

关联方:工银瑞信(上海)资产管理有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司

关联方:工银瑞信理财(国际)有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司

7.4 关联方关系

关联方:工银瑞信基金管理有限公司

关联方:中国银行股份有限公司

关联方:工银瑞信(香港)资产管理有限公司

关联方:工银瑞信(上海)资产管理有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司

关联方:工银瑞信理财(国际)有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司

7.4 关联方关系

关联方:工银瑞信基金管理有限公司

关联方:中国银行股份有限公司

关联方:工银瑞信(香港)资产管理有限公司

关联方:工银瑞信(上海)资产管理有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司

关联方:工银瑞信理财(国际)有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司

关联方:工银瑞信投资管理有限公司