

工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金托管人涉及本基金的人员存在虚假记载、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责任。
基金托管人承诺以诚实信用、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基金的招募说明书。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金
交易代码 002997
基金运作方式 约定期开放式
基金合同生效日 2016年8月25日
报告期末基金份额总额 2,696,368,4952份
投资目标 在严格控制风险的前提下，通过长期投资债券类资产的组合投资，力争在扣除一定的管理费用后，使基金净值增长率超越同期一年期银行定期存款利率。

本基金将根据市场的变化动态地调整配置策略，对GDP、CPI、国债收益率等引起变化的因素进行深入分析，从而调整投资组合。本基金在内部宏观政策上主要关注国家的财政政策、货币政策在内宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线的变化趋势进行深入研究，从而调整投资组合。本基金在宏观政策变化趋势，确定宏观投资类资产的配置并进行投资组合。

业绩比较基准 中债综合指数(总值)指数收益率。

风险收益特征 本基金为债券基金，属于低风险基金产品，其长期的预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人 招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	30,224,026.38
2.本期利润	211,147,274.1
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079
4.期末基金份额净值	2,708,438,375.0
5.期末基金份额总额	1,0306

注：1. 上述基金财务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将减小。

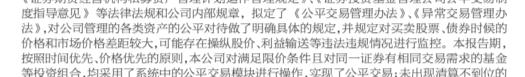
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除非日常运用的费用后的余额，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 所示数据截止到报告期最后一日，即2019年6月30日。

4.2 基金净值的表现

5. 所示数据表示以基金资产总值减去总份额乘以最近一月的平均净值计算。

6. 报告期内基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1. 本基金管理费率为每年0.3%；报告期未支付。

2. 相关的费用说明见“基金合同的条款”中的“费用”部分。

3. 所示数据截止到报告期最后一日，即2019年6月30日。

4.2.1 管理人对报告期内本基金运作合规的说明

本公司在报告期内严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同的规定，履行诚实信用、勤勉尽责的职责和运用基金资产，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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基金的招募说明书。

本公司在报告期无费用。

5.1 报告期末基金份额净值情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资	-
2 固定收益类投资	-
3 基金投资	-
4 固定收益类投资	3,392,000,500.00
5 配合固定收益类基金投资	9663
6 货币市场基金投资	2,206,023,300.00
7 股票型证券投资基金	195,000,200.00
8 其他投资	5.30
9 合计	5,910,046,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期内未按行业分类的境内股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 报告期内未按行业分类的境外股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.4 报告期内未按行业分类的境内股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期内未按行业分类的境外股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期内未按行业分类的境内股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.7 报告期内未按行业分类的境外股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.8 报告期内未按行业分类的境内股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.9 报告期内未按行业分类的境外股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金净资产比例(%)

1 国家债券	10,397,000.00
2 行业股票	-
3 中央票据	-
4 地方票据	-
5 基金	-
6 资本市场工具	-
7 其他	-
8 合计	10,397,000.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差