

## 工银瑞信中债-国债(7-10年)总指数证券投资基金

## [2017]第一季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人和董事、监事、高级管理人员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、完整性和及时性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人和中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资人在作出投资决策前应阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金管理人未获利润。

本报告期2017年1月1日至1月31日(基金合同生效日起)起3月31日止。

§ 2 基金产品概况

工银瑞信中债-国债(7-10年)指数	
交易代码	004065
场内简称	债券型
基金运作方式	封闭式
基金合同生效日	2017年1月31日
报告期末基金资产总额	200,089,790.00元
投资目标	本基金通过对债券的信用评价和动态定价的运作投资，在严格控制风险的前提下，追求在中长期限内实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过对债券的信用评价和动态定价的运作投资，在严格控制风险的前提下，追求在中长期限内实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债-国债(7-10年)指数收益率。
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低于股票型基金，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	中国农业银行股份有限公司
下属基金份额的基金简称	工银瑞信中债-国债(7-10年)指数A
下属基金份额的交易代码	004065
报告期末下属基金份额的份额总额	200,089,790.00份
报告期末下属基金份额的净值总额	59,300.10份

§ 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:2017年1月1日 - 2017年3月31日	
工银瑞信中债-国债(7-10年)指数A		工银瑞信(7-10年)指数C	
1. 本期已实现收益		1,091,263.96	343.44
2. 本期利润		563,490.63	190.77
3. 由于本期利润分配的本期利润		0.0028	0.0028
4. 期末基金资产净值		200,042,280.9	69,406.08
5. 期末可供分配基金份额总额		200,089,790.00	59,300.10

注:1. 上述基金的基金费用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。

3. 所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所交易日。

4. 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

工银瑞信中债-国债(7-10年)指数C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.2 本基金当期生效以来至累计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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.3 本基金报告期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.4 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.5 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.6 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.7 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.8 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.9 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.10 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.11 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.12 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.13 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.14 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.15 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.16 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.17 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.18 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.19 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.20 本基金当期生效以来至最近一期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0.08% 0.16% 0.09% -0.14%

3.2.21 本基金当期生效以来至最近一期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C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.02% -0