

国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金

2016 年半年度报告摘要

2016 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：二〇一六年八月二十六日

1 重要提示

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银瑞盈混合
场内简称	国投瑞盈
基金主代码	161225
交易代码	161225
基金运作方式	契约型基金。本基金合同生效后，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。本基金基金合同生效后，封闭期为 18 个月（含 18 个月），本基金封闭期自基金合同生效之日起至 18 个月后对应日前一个工作日止。
基金合同生效日	2015 年 5 月 19 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
报告期末基金份额总额	1,377,739,275.28 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略包括类别资产配置策略、股票精选策略、折价与套利策略、债券投资策略等。</p> <p>（一）类别资产配置本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。</p> <p>（二）股票投资管理 在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。个股基本面分析的主要内容包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。</p> <p>（三）折价与套利策略 折价与套利策略主要包括可转债投资策略、定向增发策略、大宗交易策略。</p> <p>（四）债券投资管理 本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p>

	<p>(五) 衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。</p> <p>2、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘凯	王永民
	联系电话	400-880-6868	010-66594896
	电子邮箱	service@ubssdic.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-880-6868	95566
传真		0755-82904048	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

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 期间数据和指标	报告期 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,049,977.33
本期利润	106,177,978.34
加权平均基金份额本期利润	0.0771
本期基金份额净值增长率	8.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1698

期末基金资产净值	1,371,872,340.92
期末基金份额净值	0.996

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中已实现部分的孰低数（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要低于所列数字。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.98%	1.39%	-0.04%	0.50%	7.02%	0.89%
过去三个月	10.30%	1.18%	-1.18%	0.51%	11.48%	0.67%
过去六个月	8.38%	1.25%	-7.67%	0.92%	16.05%	0.33%
过去一年	7.56%	1.19%	-13.46%	1.15%	21.02%	0.04%
自基金合同生效起至今	-0.40%	1.18%	-14.28%	1.22%	13.88%	-0.04%

注：1、本基金的业绩比较基准中，沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015 年 5 月 19 日至 2016 年 6 月 30 日)



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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，经中国证券监督管理委员会批准，于 2002 年 6 月 13 日正式成立，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% 的合资基金管理公司，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，建立了有效的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 2016 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 59 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，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，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 和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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘钦	本基金基金经理	2015-05-19	-	12	中国籍，硕士，具有基金从业资格，曾任职国信证券、国信弘盛投资公司。2011 年 5 月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新活力灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银瑞盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
杨冬冬	本基金基金经理、基金投资部副总监	2015-09-10	-	8	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2008 年 4 月加入国投瑞银。曾任国投瑞银创新动力基金和国投瑞银瑞福深证 100 指数分级基金基金经理助理。现任国投瑞银融华债券型证券投资基金、国投瑞银瑞利混合型证券投资基金、国投瑞银锐意改革混合型证券投资基金、国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银瑞盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、基金管理人于 2016 年 8 月 2 日发布关于本基金基金经理变更的公告，刘钦先生不再担任本基金基金经理。

2、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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效地公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年宏观经济整体趋稳，信贷规模仍然保持较高的增速，得益于基建的加大投入以及居民房屋按揭的增长；蔬菜和猪肉的价格在一季度见顶后开始回落，上半年总体 CPI 较为温和；供给侧改革的不断深化对钢铁、煤炭的价格起到一定的支撑作用，PPI 环比改善。海外来看，英国脱欧带来全球金融市场的不确定性在增加，美联储今年加息的预期减弱，全球权益市场在各国央行继续宽松的预期下大幅反弹。

板块方面，上半年抗通胀的食品饮料、贵金属的板块都涨幅居前，传媒受制于政策的不断收紧而排名最后。上半年的市场风格更多的偏向于价值，TMT 等新兴产业表现一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末（2016 年 6 月 30 日），本基金份额净值为 0.996 元，本报告期份额净值增长率为 8.38%，同期业绩比较基准收益率为-7.67%，基金净值增长高于业绩比较基准，主要原因在于精选并参与定增项目给组合带来正贡献。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在货币政策没有大的调整的情况下，市场有望延续之前的结构性行情，本基金对市场持谨慎乐观的态度，我们将持续关注美元加息进程、人民币汇率以及国内 CPI 走势，积极参与符合经济结构转型方向的投资机会。

债券方面，我们将维持适中的组合久期，以获取票息收益为主，我们认为未来的 1-2 年均为信用风险释放期，我们将严控信用风险，精选信用债。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估，并对基金估值程序进行监督；估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等事项，估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以及监察稽核部指定人员；运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，设立基金估值核算员岗负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关成员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经验。

本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值小组提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管行沟通，在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为-4,049,977.33 元，期末可供分配利润为-233,961,227.50 元。本基金本报告期末未进行收益分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-

银行存款	52,677,248.01	85,385,915.58
结算备付金	-	-
存出保证金	3,956.56	614,804.79
交易性金融资产	1,221,986,031.28	1,179,570,623.96
其中：股票投资	1,152,527,031.28	1,029,195,623.96
基金投资	-	-
债券投资	69,459,000.00	150,375,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	99,000,169.50	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	348,266.52	2,326,943.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,374,015,671.87	1,267,898,288.30
负债和所有者权益	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,625,883.99	1,570,940.99
应付托管费	270,980.68	261,823.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,452.90	146,161.22
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	234,013.38	225,000.00
负债合计	2,143,330.95	2,203,925.72
所有者权益：	-	-
实收基金	1,377,739,275.28	1,377,739,275.28
未分配利润	-5,866,934.36	-112,044,912.70
所有者权益合计	1,371,872,340.92	1,265,694,362.58
负债和所有者权益总计	1,374,015,671.87	1,267,898,288.30

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.996 元，基金份额共

1,377,739,275.28 份。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 19 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	117,114,374.58	-96,553,328.72
1.利息收入	2,227,111.38	837,108.18
其中：存款利息收入	329,692.42	837,108.18
债券利息收入	1,889,086.75	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,332.21	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,659,307.53	-52,027,633.45
其中：股票投资收益	-	-52,123,566.50
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-174,266.67	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,833,574.20	95,933.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	110,227,955.67	-45,364,873.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	2,070.17
减：二、费用	10,936,396.24	5,943,948.03
1. 管理人报酬	9,191,865.29	2,399,997.77
2. 托管费	1,531,977.61	399,999.65
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,360.30	3,097,111.40
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	199,193.04	46,839.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	106,177,978.34	-102,497,276.75
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	106,177,978.34	-102,497,276.75

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,377,739,275.28	-112,044,912.70	1,265,694,362.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	106,177,978.34	106,177,978.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,377,739,275.28	-5,866,934.36	1,371,872,340.92
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,377,739,275.28	-	1,377,739,275.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-102,497,276.75	-102,497,276.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	1,377,739,275.28	-102,497,276.75	1,275,241,998.53
---------------------	------------------	-----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王彬，主管会计工作负责人：王彬，会计机构负责人：冯伟

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 478 号《关于准予国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期间不定，首次募集期间为 2015 年 4 月 22 日至 2015 年 5 月 13 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,377,252,263.03 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 526 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,377,739,275.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 487,012.25 份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金基金合同生效后，封闭期为 18 个月(含 18 个月)，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

经深圳交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]389 号文审核同意，本基金 216,230,892.00 份基金份额于 2015 年 8 月 14 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；转换为上市开放式基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产的 3%。在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金(LOF)后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无需要说明的重大会计差错和更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1

年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额, 自 2015 年 9 月 8 日起, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间, 均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年5月19日(基金合 同生效日)至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,191,865.29	2,399,997.77
其中: 支付销售机构的客户维护 费	1,821,658.51	486,015.48

注: 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费率的计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年5月19日（基金合 同生效日）至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,531,977.61	399,999.65

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年5月19日（基金合同生 效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	52,677,248.01	328,175.22	671,288,233.55	828,879.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300256	星星科技	2015-11-09	2016-11-11	非公开发行	7.50	14.34	10,666.00	79,999.995.00	152,959.990.44	-
600604	市北高新	2015-08-24	2016-08-22	非公开发行	9.91	21.91	5,045,408.00	49,999,993.28	110,544.889.28	-
300247	乐金健康	2015-11-10	2016-11-14	非公开发行	5.73	7.37	11,353,710.00	64,999,989.75	83,676,842.70	-
002600	江粉磁材	2015-09-14	2016-09-15	非公开发行	5.75	10.70	6,956,521.00	39,999,995.75	74,434,774.70	-
600200	江苏吴中	2015-10-16	2016-10-13	非公开发行	12.52	17.47	4,153,354.00	51,999,992.08	72,559,094.38	-

600984	建设机械	2015-11-20	2016-11-17	非公开发行	7.22	8.11	8,800,000.00	63,536,000.00	71,368,000.00	-
000685	中山公用	2015-12-04	2016-12-07	非公开发行	12.02	10.38	6,738,768.00	80,999,991.36	69,948,411.84	-
600619	海立股份	2015-11-06	2016-11-04	非公开发行	7.90	10.63	6,329,113.00	49,999,992.70	67,278,471.19	-
002427	尤夫股份	2015-07-13	2016-07-14	非公开发行	15.02	19.88	3,328,895.00	50,000,002.90	66,178,432.60	-
600845	宝信软件	2015-10-23	2016-10-21	非公开发行	21.46	22.02	2,719,012.00	58,349,997.52	59,872,644.24	-
002314	南山控股	2015-07-30	2016-08-05	非公开发行	8.81	6.83	7,718,501.00	67,999,993.81	52,717,361.83	-
600682	南京新百	2015-11-27	2016-11-24	非公开发行	20.10	25.12	1,990,049.00	39,999,984.90	49,990,030.88	-
002535	林州重机	2015-07-16	2016-07-18	非公开发行	10.38	8.08	5,777,777.00	59,999,994.00	46,684,438.16	-
600390	*ST金瑞	2015-07-14	2016-07-14	非公开发行	11.02	13.36	3,176,043.00	34,999,993.86	42,431,934.48	-
002230	科大讯飞	2015-08-19	2016-08-22	非公开发行	31.46	32.63	1,271,455.00	39,999,974.30	41,487,576.65	-
600980	北矿科技	2015-11-06	2016-11-04	非公开发行	18.01	25.18	1,081,844.00	19,484,010.44	27,240,831.92	-
002201	九鼎新材	2015-07-21	2016-07-22	非公开发行	16.51	14.23	248,335.00	4,100,010.85	3,533,807.05	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股未上市	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股未上市	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002632	道明光学	2016-06-21	重大事项停牌	11.98	-	-	1,646,090.00	19,999,993.50	19,720,158.20	-
002052	同洲电子	2016-01-11	重大事项停牌	10.03	-	-	1,538,300.00	26,844,734.42	15,429,149.00	-
300032	金龙机电	2016-06-27	重大事项停牌	20.10	2016-07-07	19.80	668,500.00	12,363,085.48	13,436,850.00	-
300508	维宏股份	2016-06-29	股票交易价格波动停牌	254.50	2016-07-06	242.00	970.00	19,477.60	246,865.00	-
300503	昊志机电	2016-06-29	股票交易价格波动停牌	84.72	2016-07-05	82.99	1,863.00	14,382.36	157,833.36	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,152,527,031.28	83.88
	其中：股票	1,152,527,031.28	83.88

2	固定收益投资	69,459,000.00	5.06
	其中：债券	69,459,000.00	5.06
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	99,000,169.50	7.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	52,677,248.01	3.83
7	其他各项资产	352,223.08	0.03
8	合计	1,374,015,671.87	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	692,013,542.88	50.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,948,411.84	5.10
E	建筑业	52,920,979.60	3.86
F	批发和零售业	49,990,030.88	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,200,231.57	7.45
J	金融业	565,780.41	0.04
K	房地产业	110,544,889.28	8.06

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,784,070.44	0.13
S	综合	72,559,094.38	5.29
	合计	1,152,527,031.28	84.01

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300256	星星科技	10,666,666.00	152,959,990.44	11.15
2	600604	市北高新	5,045,408.00	110,544,889.28	8.06
3	300247	乐金健康	11,353,710.00	83,676,842.70	6.10
4	002600	江粉磁材	6,956,521.00	74,434,774.70	5.43
5	600200	江苏吴中	4,153,354.00	72,559,094.38	5.29
6	600984	建设机械	8,800,000.00	71,368,000.00	5.20
7	000685	中山公用	6,738,768.00	69,948,411.84	5.10
8	600619	海立股份	6,329,113.00	67,278,471.19	4.90
9	002427	尤夫股份	3,328,895.00	66,178,432.60	4.82
10	600845	宝信软件	2,719,012.00	59,872,644.24	4.36

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300032	金龙机电	12,363,085.48	0.98
2	002797	第一创业	148,970.64	0.01
3	002792	通宇通讯	70,678.14	0.01
4	002790	瑞尔特	50,104.76	0.00
5	002789	建艺集团	33,795.00	0.00
6	300474	景嘉微	33,649.88	0.00
7	300516	久之洋	33,142.50	0.00
8	300518	盛讯达	29,019.32	0.00
9	002795	永和智控	21,532.50	0.00
10	300508	维宏股份	19,477.60	0.00
11	300505	川金诺	19,403.25	0.00
12	002793	东音股份	16,913.61	0.00
13	300510	金冠电气	16,789.50	0.00
14	300506	名家汇	15,607.02	0.00
15	002802	洪汇新材	15,508.08	0.00
16	300503	昊志机电	14,382.36	0.00
17	300515	三德科技	11,612.35	0.00
18	002798	帝王洁具	11,161.92	0.00
19	300520	科大国创	9,306.30	0.00
20	002799	环球印务	8,618.40	0.00

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未发生股票卖出。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,948,390.41
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,455,000.00	3.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,004,000.00	1.46
	其中：政策性金融债	20,004,000.00	1.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,459,000.00	5.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	020115	16 贴债 17	500,000	49,455,000.00	3.60
2	160414	16 农发 14	200,000	20,004,000.00	1.46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下以套期保值为目的，适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货提高投资组合的运作效率。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,956.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	348,266.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	352,223.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300256	星星科技	152,959,990.44	11.15	非公开发行
2	600604	市北高新	110,544,889.28	8.06	非公开发行
3	300247	乐金健康	83,676,842.70	6.10	非公开发行
4	002600	江粉磁材	74,434,774.70	5.43	非公开发行
5	600200	江苏吴中	72,559,094.38	5.29	非公开发行
6	600984	建设机械	71,368,000.00	5.20	非公开发行
7	000685	中山公用	69,948,411.84	5.10	非公开发行
8	600619	海立股份	67,278,471.19	4.90	非公开发行
9	002427	尤夫股份	66,178,432.60	4.82	非公开发行
10	600845	宝信软件	59,872,644.24	4.36	非公开发行

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份	持有份额	占总份

			额比例		额比例
14,117	97,594.34	647,610,156.73	47.01%	730,129,118.55	52.99%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	47,146,501.00	19.34%
2	国泰君安证券股份有限公司	10,095,155.00	4.14%
3	恒安标准人寿保险有限公司—投连险05	9,622,600.00	3.95%
4	泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L-CT001	7,395,575.00	3.03%
5	广东粤财信托有限公司—粤财信托·粤银1号证券投资单一资金	4,537,300.00	1.86%
6	大同证券—兴业银行—大同证券同享成长1号集合资产管理计划	2,931,429.00	1.20%
7	瑞泰人寿保险有限公司—万能	2,814,612.00	1.15%
8	泰康资产—工商银行—东莞银行股份有限公司	2,579,560.00	1.06%
9	泰康人寿保险股份有限公司—万能—个险万能	2,128,255.00	0.87%
10	蒙丽冰	2,102,900.00	0.86%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	257,088.52	0.02%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 19 日）基金份额总额	1,377,739,275.28
本报告期期初基金份额总额	1,377,739,275.28
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,377,739,275.28

注：本基金合同生效后 18 个月之内（含 18 个月）为封闭期，在此间投资者不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、刘纯亮先生自 2016 年 2 月 3 日起不再担任管理人总经理；
 - 2、王彬女士自 2016 年 2 月 3 日起担任管理人总经理；
 - 3、包爱丽女士自 2016 年 2 月 3 日起不再担任管理人副总经理。
- 另，储诚忠先生自 2016 年 8 月 12 日起任管理人副总经理。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基

金财产、基金托管业务相关的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金继续聘请普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务，未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	12,363,085.48	100.00%	11,513.80	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本报告期内本基金未发生交易所债券、回购及权证交易。

3、本报告期本基金新增租用第一创业、华泰证券、西藏东方财富、中泰证券及国联证券各 1 个交易单元。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日