

**国投瑞银瑞兴保本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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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       | 国投瑞银瑞兴保本混合         |
| 基金主代码      | 002242             |
| 交易代码       | 002242             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015 年 12 月 29 日   |
| 基金管理人      | 国投瑞银基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,986,230,838.25 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金追求在有效控制风险的基础上，运用投资组合保险技术，为投资者提供保本周期到期时保本金额安全的保证，并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资策略 | <p>本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下，采用 CPPI（Constant Proportion Portfolio Insurance）恒定比例组合保险策略和 TIPP（Time Invariant Portfolio Protection）时间不变性投资组合保险策略来实现保本和增值的目标。</p> <p>本基金的投资策略包含资产配置策略、风险资产投资策略和安全资产投资策略等。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和安全资产的配置，该层次以组合保险策略为依据，即风险资产可能的损失额不超过安全垫；另一层为对风险资产、安全资产内部的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。</p> <p>2、风险资产投资策略</p> <p>风险资产投资策略主要包括股票投资策略和股指期货投资管理策略。</p> <p>3、安全资产投资策略</p> <p>①持有相当数量剩余期限与保本周期相近的债券，主要按买入并持有方式进行投资以保证组合收益的稳定性，同时兼顾收益性和流动性，尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。</p> <p>②综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资，严格控制风险，增强盈利性，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。</p> <p>4、国债期货投资管理</p> <p>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 | 两年期银行定期存款收益率（税后）             |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 |

### 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        | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘凯                  | 田青                   |
|             | 联系电话 | 400-880-6868        | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | service@ubssdic.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 400-880-6868        | 010-67595096         |
| 传真          |      | 0755-82904048       | 010-66275853         |

### 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 | <a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a> |
| 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       | 17,173,811.46                        |
| 本期利润          | 26,361,419.84                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0132                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.30%                                |
| 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  | 0.0086                               |
| 期末基金资产净值      | 2,012,498,622.14                     |
| 期末基金份额净值      | 1.013                                |

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      | 0.60%    | 0.05%       | 0.17%      | 0.01%         | 0.43% | 0.04% |
| 过去三个月      | 0.70%    | 0.06%       | 0.52%      | 0.01%         | 0.18% | 0.05% |
| 过去六个月      | 1.30%    | 0.06%       | 1.05%      | 0.01%         | 0.25% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.30%    | 0.06%       | 1.07%      | 0.01%         | 0.23% | 0.05% |

注：1.本基金是保本型基金，保本周期最长为两年，保本但不保证收益率。以中国人民银行公布的两年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

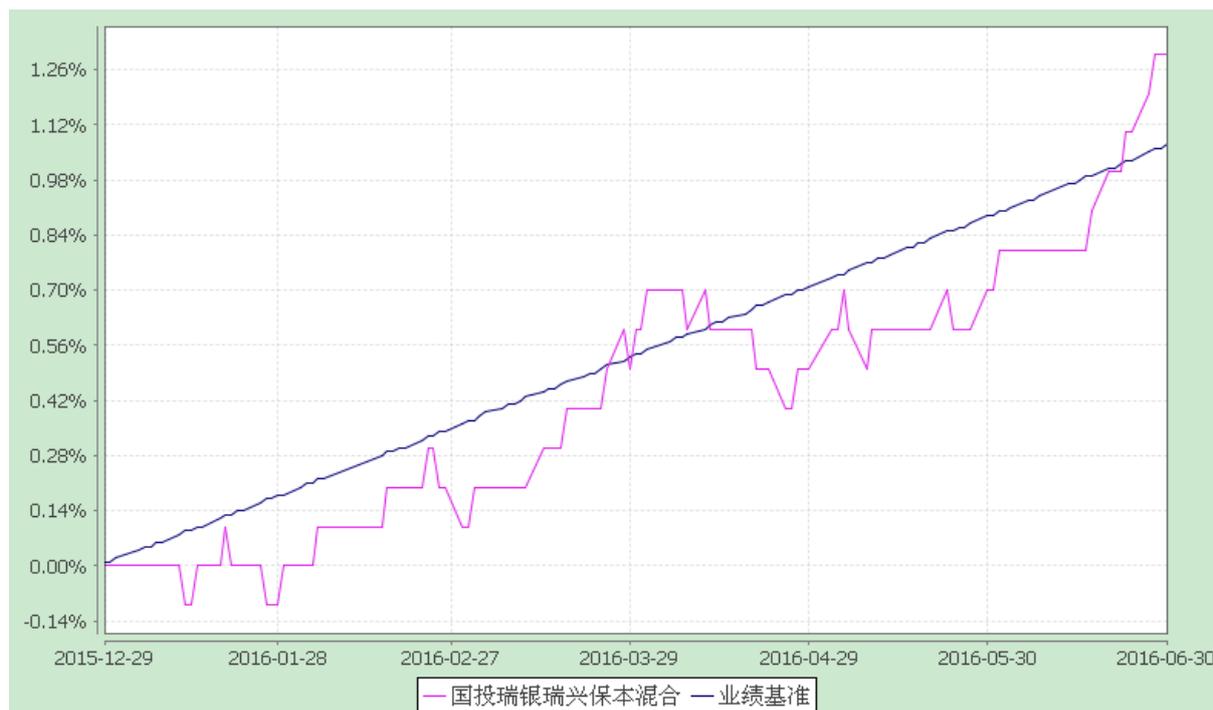
3、本基金基金合同生效日为 2015 年 12 月 29 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

#### 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

国投瑞银瑞兴保本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 12 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。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。

2、本基金基金合同生效日为 2015 年 12 月 29 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

## 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       |        |  |
| 王鹏  | 本基金基金经理 | 2016-01-21      | -          | 8      | 中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任上海市发改委综合经济研究所助理研究员，万家基金管理有限公司研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员。2012 年 5 月加入国投瑞银。现任国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金和国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金基金经理。            |
| 狄晓娇 | 本基金基金经理 | 2016-06-02      | -          | 7      | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。2010 年 7 月加入国投瑞银基金，2011 年 7 月转入固定收益部任研究员。现任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金、国投瑞银进宝保本混合型证券投资基金、国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金和国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 刘兴旺 | 本基金基金经理 | 2015-12-29      | 2016-06-02 | 11     | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任职申银万国证券、华宝兴业基金、泰信基金。2012 年 11 月加入国投瑞银。现任国投瑞银纯债债券基金、国投瑞银中高等级债券基金、国投瑞银岁添利一年期定期开放债券基金、国投瑞银稳定增利债券基金、国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券基金、国投瑞银进宝保本混合型基                    |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 金、国投瑞银瑞兴保本混合型基金和国投瑞银瑞祥保本混合型基金基金经理。曾任泰信周期回报债券型证券投资基金和泰信天天收益开放式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银瑞兴保本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，本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，以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，形成了有效的公平交易体系。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，在经历了持续的货币宽松和各个地方对房地产的支持的政策之后，

房地产销售回暖、新开工由负转正，宏观经济有企稳态势；供给侧改革稳步推进，在煤炭、钢铁等行业取得一定成效。国际市场，英国公投脱欧，全球金融市场增加了不确定性。

本基金是保本基金，目前仍处于依靠债券投资积累安全垫的过程。因此，股票仓位维持较低水平。对于债券投资，我们秉持以下原则：第一，出于对未来企业违约的担心，规避违约风险，而不是去追逐高风险收益率品种；第二，基于对利率走势的不确定，规避利率风险，投资短久期的品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.013 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.05%。基金净值增长率高于业绩比较基准，主要原因在于：第一，基于对市场的谨慎，保持了较低的仓位；第二，部分持仓股票实现了超额收益；第三，债券投资不断积累安全垫。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

诚如 2015 年报所言，2016 年是很复杂的一年。货币超发、总和杠杆率高、产能过剩、改革进入深水区等，与此同时，扣除金融股后的股市估值相对不低。

我们或许正站在十字路口：一个方向，股市由于诸多不确定因素存在自然的下跌调整；另一个方向，政府对楼市的强刺激，使得股市处于相对的配置优势，从而存在一波泡沫的再起。上证指数一直困局在 3000 点左右，也多少反映了这种纠结。

从逻辑角度判断，我们认为后一种情况出现的概率会更低。2016 年 5 月权威人士在人民日报的撰文，进一步印证了我们的判断。目前这个阶段，我们建议保持中性仓位，以静制动。

#### 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位负责日常估值业务。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 17,173,811.46 元，期末可供分配利润为 17,081,079.81 元。

本基金本报告期末未进行利润分配。

### **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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

#### **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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关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**

本托管人复核审查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。

## 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：国投瑞银瑞兴保本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<br>2016 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      | -                              | -                                |
| 银行存款            | 538,616,152.48                 | 1,998,023,266.34                 |
| 结算备付金           | 1,620,706.34                   | -                                |
| 存出保证金           | 57,308.10                      | -                                |
| 交易性金融资产         | 1,370,310,338.34               | 9,994,510.20                     |
| 其中：股票投资         | 49,964,039.95                  | -                                |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 1,320,346,298.39               | 9,994,510.20                     |
| 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        | 50,000,275.00                  | 700,000,000.00                   |
| 应收证券清算款         | 40,009,658.47                  | -                                |
| 应收利息            | 14,458,885.81                  | 244,008.96                       |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 149.34                         | -                                |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     | <b>2,015,073,473.88</b>        | <b>2,708,261,785.50</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      | -                              | -                                |
| 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         | -                              | 710,100,481.95                   |
| 应付赎回款           | 102,238.70                     | -                                |
| 应付管理人报酬         | 1,973,238.41                   | 131,375.68                       |
| 应付托管费           | 328,873.05                     | 21,895.94                        |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 20,141.16                      | -                                |
| 应交税费            | -                              | -                                |

|                   |                         |                         |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| 应付利息              | -                       | -                       |
| 应付利润              | -                       | -                       |
| 递延所得税负债           | -                       | -                       |
| 其他负债              | 150,360.42              | -                       |
| <b>负债合计</b>       | <b>2,574,851.74</b>     | <b>710,253,753.57</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     | <b>-</b>                | <b>-</b>                |
| 实收基金              | 1,986,230,838.25        | 1,998,023,466.34        |
| 未分配利润             | 26,267,783.89           | -15,434.41              |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>2,012,498,622.14</b> | <b>1,998,008,031.93</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>2,015,073,473.88</b> | <b>2,708,261,785.50</b> |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.013 元，基金份额总额 1,986,230,838.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞兴保本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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>42,046,447.10</b>                  |
| 1.利息收入                | 31,143,618.96                         |
| 其中：存款利息收入             | 16,724,194.66                         |
| 债券利息收入                | 11,871,502.57                         |
| 资产支持证券利息收入            | -                                     |
| 买入返售金融资产收入            | 2,547,921.73                          |
| 其他利息收入                | -                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 1,625,963.53                          |
| 其中：股票投资收益             | 1,601,113.25                          |
| 基金投资收益                | -                                     |
| 债券投资收益                | -19,767.17                            |
| 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                  | 44,617.45                             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 9,187,608.38                          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 89,256.23                             |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>15,685,027.26</b>                  |
| 1. 管理人报酬              | 11,954,001.90                         |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| 2. 托管费                     | 1,992,333.59         |
| 3. 销售服务费                   | -                    |
| 4. 交易费用                    | 107,608.52           |
| 5. 利息支出                    | 1,453,027.57         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 1,453,027.57         |
| 6. 其他费用                    | 178,055.68           |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> | <b>26,361,419.84</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   | <b>26,361,419.84</b> |

注：本基金于 2015 年 12 月 29 日合同生效，因此无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞兴保本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<br>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<br>(基金净值)                                | 1,998,023,466.34                      | -15,434.41    | 1,998,008,031.93 |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本期<br>利润)                   | -                                     | 26,361,419.84 | 26,361,419.84    |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动<br>数(净值减少以“-”号<br>填列)      | -11,792,628.09                        | -78,201.54    | -11,870,829.63   |
| 其中：1.基金申购款   | 111,093.36                            | 739.72        | 111,833.08       |
| 2.基金赎回款  | -11,903,721.45                        | -78,941.26    | -11,982,662.71   |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -                                     | -             | -                |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 1,986,230,838.25                      | 26,267,783.89 | 2,012,498,622.14 |

注：本基金于 2015 年 12 月 29 日合同生效，因此无上年度可比期间数据。

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

国投瑞银瑞兴保本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] 2777 号《关于准予国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金注册的批复》核准,由本基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞兴保本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 12 月 11 日至 2016 年 1 月 8 日。根据本基金管理人 2015 年 12 月 25 日发布的《关于国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金提前结束募集的公告》,国投瑞银瑞兴保本基金于 2015 年 12 月 25 日提前结束募集。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 1469 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,997,099,100.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 924,365.65 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,注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,基金担保人为中国投融资担保股份有限公司。

根据《国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金合同》的有关约定,基金第一个保本周期最长为 2 年,目标收益率为 18%。第一个保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积(即“可赎回金额”)加上该部分基金份额在第一个保本周期的累计分红款项之和低于其保本金额,基金管理人应补足该差额(即保本赔付差额)。

本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(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。

本基金将基金资产划分为安全资产和风险资产,其中安全资产主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、国债期货、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种。风险资产主要投资于股票、权证、股指期货等权益

类品种，以及符合基金管理人风险资产投资标准的固定收益类品种，具体在招募说明书中列示。

本基金持有的安全资产占基金资产的比例不低于 60%。本基金持有的风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为两年期银行定期存款收益率（税后）。

#### **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》、《国投瑞银瑞兴保本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 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

人民币

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.9 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 基金的收益分配政策**

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 50%；
- 4、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配方式：
  - (1) 保本周期内：本基金收益分配方式为现金分红，不进行红利再投资；
  - (2) 变更为非保本的混合型基金后：本基金收益分配方式为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司 ("建设银行") | 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<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 11,954,001.90              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,751,612.40               |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人根据与基金托管人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

其中，在基金保本周期内，本基金的保证费用或风险买断费用从基金管理人的管理

费收入中列支。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |              |
|----|----------------------------|--------------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费             | 1,992,333.59 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人根据与基金托管人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |            |
|------------|----------------------------|------------|
|            | 期末余额                       | 当期利息收入     |
| 中国建设银行股份有限 | 18,616,152.48              | 348,204.59 |

|    |  |  |
|----|--|--|
| 公司 |  |  |
|----|--|--|

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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

本基金本报告期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

| 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       |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|------------|--------------|
| 300508 | 维宏股份 | 2016-04-12 | -          | 新股锁定   | 20.08 | 254.50 | 10,383.00 | 208,490.64 | 2,642,473.50 |
| 603016 | 新宏泰  | 2016-06-23 | 2016-07-01 | 新股未上市  | 8.49  | 8.49   | 1,602.00  | 13,600.98  | 13,600.98    |
| 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       | 复牌开盘价 | 数量(单位：股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额        |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|-------|------------|--------------|---------------|
| 000651 | 格力电器 | 2016-02-22 | 重大事项停牌 | 22.07  | -          | -     | 279,500.00 | 5,568,331.44 | 46,168,565.00 |
| 601611 | 中国核建 | 2016-06-30 | 股票交易异常 | 20.92  | 2016-07-01 | 23.01 | 37,059.00  | 128,594.73   | 775,274.28    |

|  |  |  |      |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|------|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  | 波动停牌 |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|------|--|--|--|--|--|--|

### 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              | 49,964,039.95    | 2.48          |
|    | 其中：股票             | 49,964,039.95    | 2.48          |
| 2  | 固定收益投资            | 1,320,346,298.39 | 65.52         |
|    | 其中：债券             | 1,320,346,298.39 | 65.52         |
|    | 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          | 50,000,275.00    | 2.48          |
|    | 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      | 540,236,858.82   | 26.81         |
| 7  | 其他各项资产            | 54,526,001.72    | 2.71          |
| 8  | 合计                | 2,015,073,473.88 | 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              | 46,338,991.92 | 2.30          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | 775,274.28    | 0.04          |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| 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  | 2,712,965.90  | 0.13          |
| J  | 金融业              | -             | -             |
| K  | 房地产业             | -             | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 136,807.85    | 0.01          |
| 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        | -             | -             |
| S  | 综合               | -             | -             |
|    | 合计               | 49,964,039.95 | 2.48          |

## 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  | 600771 | 广誉远  | 1,074,452.00 | 31,309,531.28 | 1.56 |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 279,500.00   | 6,168,565.00  | 0.31 |
| 3  | 000538 | 云南白药 | 68,600.00    | 4,410,980.00  | 0.22 |
| 4  | 000590 | 启迪古汉 | 133,500.00   | 2,958,360.00  | 0.15 |
| 5  | 300508 | 维宏股份 | 10,383.00    | 2,642,473.50  | 0.13 |
| 6  | 601611 | 中国核建 | 37,059.00    | 775,274.28    | 0.04 |
| 7  | 300516 | 久之洋  | 1,473.00     | 258,025.41    | 0.01 |
| 8  | 601127 | 小康股份 | 8,662.00     | 206,761.94    | 0.01 |
| 9  | 603737 | 三棵树  | 1,327.00     | 154,038.16    | 0.01 |
| 10 | 603339 | 四方冷链 | 2,793.00     | 151,995.06    | 0.01 |

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  | 600771 | 广誉远  | 27,542,322.06 | 1.38            |
| 2  | 600038 | 中直股份 | 10,987,410.00 | 0.55            |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 7,996,881.00  | 0.40            |
| 4  | 000538 | 云南白药 | 4,336,089.00  | 0.22            |
| 5  | 002013 | 中航机电 | 2,998,249.00  | 0.15            |
| 6  | 000590 | 启迪古汉 | 2,858,586.37  | 0.14            |
| 7  | 600410 | 华胜天成 | 1,998,888.25  | 0.10            |
| 8  | 002797 | 第一创业 | 212,044.56    | 0.01            |
| 9  | 300508 | 维宏股份 | 208,490.64    | 0.01            |
| 10 | 601611 | 中国核建 | 128,594.73    | 0.01            |
| 11 | 603919 | 金徽酒  | 72,247.76     | 0.00            |
| 12 | 002792 | 通宇通讯 | 70,678.14     | 0.00            |
| 13 | 603868 | 飞科电器 | 59,372.79     | 0.00            |
| 14 | 601127 | 小康股份 | 50,326.22     | 0.00            |
| 15 | 002790 | 瑞尔特  | 50,104.76     | 0.00            |
| 16 | 603861 | 白云电器 | 34,476.00     | 0.00            |
| 17 | 002789 | 建艺集团 | 33,795.00     | 0.00            |
| 18 | 300474 | 景嘉微  | 33,649.88     | 0.00            |
| 19 | 300516 | 久之洋  | 33,142.50     | 0.00            |
| 20 | 601020 | 华钰矿业 | 31,426.86     | 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600038 | 中直股份 | 10,641,784.01 | 0.53           |
| 2  | 002013 | 中航机电 | 2,847,605.60  | 0.14           |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 2,342,298.00  | 0.12           |
| 4  | 600410 | 华胜天成 | 1,755,292.00  | 0.09           |
| 5  | 002797 | 第一创业 | 697,670.19    | 0.03           |
| 6  | 300474 | 景嘉微  | 348,083.21    | 0.02           |
| 7  | 603528 | 多伦科技 | 272,959.92    | 0.01           |
| 8  | 002792 | 通宇通讯 | 237,299.81    | 0.01           |
| 9  | 603919 | 金徽酒  | 214,298.84    | 0.01           |
| 10 | 603868 | 飞科电器 | 174,342.05    | 0.01           |
| 11 | 601020 | 华钰矿业 | 113,857.59    | 0.01           |
| 12 | 300503 | 昊志机电 | 113,143.05    | 0.01           |
| 13 | 603861 | 白云电器 | 110,309.84    | 0.01           |
| 14 | 603101 | 汇嘉时代 | 100,612.82    | 0.01           |
| 15 | 300505 | 川金诺  | 95,292.25     | 0.00           |
| 16 | 603798 | 康普顿  | 94,403.70     | 0.00           |
| 17 | 002789 | 建艺集团 | 91,965.00     | 0.00           |
| 18 | 603028 | 赛福天  | 89,282.01     | 0.00           |
| 19 | 300506 | 名家汇  | 83,432.97     | 0.00           |
| 20 | 002793 | 东音股份 | 80,585.26     | 0.00           |

注：“卖出金额”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。

#### 7.4.3 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 | 60,226,180.12 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 20,794,622.03 |

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      | 131,428,580.10   | 6.53         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,052,000.00    | 1.00         |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,052,000.00    | 1.00         |
| 4  | 企业债券      | 210,868,433.29   | 10.48        |
| 5  | 企业短期融资券   | 630,645,000.00   | 31.34        |
| 6  | 中期票据      | 71,536,000.00    | 3.55         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 7,731,285.00     | 0.38         |
| 8  | 同业存单      | 248,085,000.00   | 12.33        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,320,346,298.39 | 65.61        |

**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  | 041651008 | 16 电网 CP001   | 2,000,000 | 200,040,000.00 | 9.94         |
| 2  | 111616103 | 16 上海银行 CD103 | 1,000,000 | 99,240,000.00  | 4.93         |
| 3  | 111694572 | 16 宁波银行 CD131 | 1,000,000 | 99,220,000.00  | 4.93         |
| 4  | 019515    | 15 国债 15      | 702,520   | 70,244,974.80  | 3.49         |
| 5  | 122921    | 10 郴州债        | 642,730   | 65,474,905.10  | 3.25         |

**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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

### 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。

#### 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的发行主体本期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   | 57,308.10     |
| 2  | 应收证券清算款 | 40,009,658.47 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 14,458,885.81 |
| 5  | 应收申购款   | 149.34        |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 54,526,001.72 |

#### 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  | 000651 | 格力电器 | 6,168,565.00 | 0.31         | 重大事项停牌     |
| 2  | 300508 | 维宏股份 | 2,642,473.50 | 0.13         | 新股锁定       |
| 3  | 601611 | 中国核建 | 775,274.28   | 0.04         | 股票交易异常波动停牌 |

#### 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             | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 3,573    | 555,900.04 | 1,630,770,778.08 | 82.10% | 355,460,060.17 | 17.90% |

### 8.2 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 | 244,060.66 | 0.01%    |

### 8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，本基金基金经理于本报告期末均未持有本基金份额。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 12 月 29 日）基金份额总额 | 1,998,023,466.34 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 1,998,023,466.34 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 111,093.36       |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 11,903,721.45    |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 1,986,230,838.25 |

## 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

报告期内本基金初次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 |    |
| 海通证券 | 1      | 54,229,207.45 | 68.20%       | 50,503.26 | 68.20%     | -  |
| 安信证券 | 1      | 25,283,840.26 | 31.80%       | 23,546.87 | 31.80%     | -  |

#### 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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 回购交易             |              | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 海通证券 | 802,633,303.39 | 95.41%       | 5,689,400,000.00 | 91.74%       | -    | -            |
| 安信证券 | 38,629,962.99  | 4.59%        | 512,146,000.00   | 8.26%        | -    | -            |

注：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、本基金本报告期未发生交易所权证交易。

3、本基金本报告期交易席位未发生变化。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日