

**国投瑞银招财保本混合型证券投资基金**

**2016 年半年度报告**

**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 重要提示及目录

### 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。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10 |
| 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.....             | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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.....     | 13 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 13 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 34 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 35 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 38 |
| 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.....      | 38 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 39 |
| 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.....   | 39 |
| 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.....      | 39 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 39 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 40 |

|  |    |
|--|----|
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....               | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 41 |
| 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..... | 41 |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....               | 42 |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                 | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 42 |
| 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.....  | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 43 |
| 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.....     | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 43 |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 44 |
| <b>11 备查文件目录</b> .....                 | 45 |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 45 |
| 11.2 存放地点.....                         | 45 |
| 11.3 查阅方式.....                         | 45 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 国投瑞银招财保本混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 国投瑞银招财保本混合         |
| 基金主代码      | 001266             |
| 交易代码       | 001266             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015 年 6 月 3 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 | 2,023,982,775.66 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、收益资产投资策略和保本资产投资策略等。</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：一层为对收益资产和保本资产的配置，该层次以组合保险策略为依据，即收益资产可能的损失额不超过安全垫；另一层为对收益资产、保本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、收益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、保本资产投资策略</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> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 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。 |
| 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            | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>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         |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区东大名路638号7层        | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层 | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 邮政编码        |      | 518035                  | 100818               |
| 法定代表人       |      | 叶柏寿                     | 田国立                  |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《证券时报》、《上海证券报》  |
| 登载基金半年度报告正文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                                 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称            | 办公地址                         |
|--------|---------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 国投瑞银基金管理有限公司  | 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层  |
| 基金保证人  | 中国投融资担保股份有限公司 | 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 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       | 1,473,004.98              |
| 本期利润          | -704,163.11               |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0003                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.03%                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.00%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 22,198,496.75             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0110                    |
| 期末基金资产净值      | 2,054,377,150.53          |
| 期末基金份额净值      | 1.015                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 1.50%                     |

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 | 0.40%    | 0.04%       | 0.17%      | 0.01%         | 0.23%  | 0.03% |
| 过去三个月 | 0.59%    | 0.04%       | 0.52%      | 0.01%         | 0.07%  | 0.03% |
| 过去六个月 | 0.00%    | 0.12%       | 1.05%      | 0.01%         | -1.05% | 0.11% |
| 过去一年  | 1.70%    | 0.13%       | 2.24%      | 0.01%         | -0.54% | 0.12% |

|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.50% | 0.12% | 2.47% | 0.01% | -0.97% | 0.11% |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|

注：1、本基金是保本型基金，保本周期为两年，保本但不保证收益率。以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。

### 3.2.2 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

国投瑞银招财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 6 月 3 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。

## 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 |        |  |
| 李怡文 | 本基金基金经理，固定收益部副总监 | 2015-06-03      | -    | 15     | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任 Frolely Revy Investment Company 分析师、中国建设银行（香港）资产组合经理。2008 年 6 月加入国投瑞银，现任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金、国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金、国投瑞银纯债债券型证券投资基金、国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银岁增利一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银招财保本混合型证券投资基金、国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金和国投瑞银和安债券型证券投资基金基金经理。 |
| 綦缚鹏 | 本基金基金经理          | 2016-01-19      | -    | 13     | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任华林证券研究员、中国建银投资证券高级研究员、泰信基金高级研究员和基金经理助理。2009 年 4 月加入国投瑞银。曾任国投瑞银核心企业混合型证券投资基金  |

|     |         |            |   |   |  |
|-----|---------|------------|---|---|--|
|     |         |            |   |   | 基金经理。现任国投瑞银成长优选混合型证券投资基金、国投瑞银国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银招财保本混合型证券投资基金和国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。                            |
| 颜文浩 | 本基金基金经理 | 2016-04-15 | - | 6 | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。2010 年 10 月加入国投瑞银。现任国投瑞银钱多宝货币市场基金、国投瑞银增利宝货币市场基金、国投瑞银添利宝货币市场基金、国投瑞银招财保本混合型证券投资基金、国投瑞银全球债券精选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。 |

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《国投瑞银招财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

上半年，经济基本面经历了短暂的反弹之后继续底部震荡。一季度经济基本面短暂复苏，由房地产销售带动的居民中长期贷款增量明显，同时政府主导的新开工项目计划投资额较去年同比大幅增长，固定资产投资增速加快，通胀预期有所抬升，加上一季度末央行实行 MPA 考核，引发非银体系的资金面波动，长债收益率显著调整；此外，中铁物资兑付危机引发市场对信用风险的担忧，并持续发酵，导致信用债收益率整体调整，信用利差大幅走扩。进入 5 月份以来，随着风险因素持续释放，基本面转为平淡，加上权威人士讲话，带动市场预期发生改变，收益率转为下行，尤其 6 月份以来，长久期利率债收益率下行明显，10 年期国开债收益率从 6 月份的 3.3% 下行至 3.2% 以下的水平，并在 3.2% 附近窄幅波动。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额净值为 1.015 元，本报告期份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.05%，基金净值增长率低于业绩基准的主要原因在于年初股票市场快速向下熔断，给权益类资产带来负面冲击。

#### 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，经济基本面预计难有超预期表现，房地产投资的可持续性存疑，制造业投资难有起色，预计政策方面仍会以基建托底经济。信贷方面三季度传统上不是旺季，通胀在食品价格继续下行的带动下预计同比会下行至 2% 以下。不过考虑到稳增长的重要性，三季度财政政策刺激可能加码，美联储短期加息概率不大，但仍需持续关注其非农就业数据，国内债券收益率整体上仍以区间震荡为主，收益率曲线偏平坦化。预计货币政策仍将维持中性，央行汇率和通胀的双重权衡之下，预计短期不会继续大幅度降准

降息，但在供给侧改革、去产能和去杠杆尚未结束的背景下，下半年预计货币政策将保持稳健。

对于股票市场而言，我们判断整体走势以大幅区间震荡为主，但是困难在于全球风险集聚压制风险偏好，国内经济短期难言见底压制公司盈利，股票估值普遍偏高，向上大幅突破的空间也不大。因此接下来一段时间内，我们将保持谨慎乐观的投资判断，希望通过灵活控制股票仓位，精选估值合理基本面良好的个股积累收益。债券方面，我们将以纯债投资为主，信用债以中高评级匹配组合到期期限的个券为主，利率债参与波段交易，转债积极参与一级申购。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历。

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 1,473,004.98 元，期末可供分配利润为 22,198,496.75 元。

本基金本报告期内未进行收益分配。

## 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”）在对国投瑞银招财保本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：国投瑞银招财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  | 附注号 | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： |     | -                      | -                        |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 425,581,136.26                 | 56,210,374.17                    |
| 结算备付金           |            | 38,564,393.49                  | 27,023,412.91                    |
| 存出保证金           |            | 1,581,263.63                   | 58,043,217.68                    |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,575,434,624.17               | 1,769,839,823.13                 |
| 其中：股票投资         |            | 37,197,999.37                  | 149,992,654.07                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 1,538,236,624.80               | 1,619,847,169.06                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | 679,882,129.51                   |
| 应收证券清算款         |            | 412,253.40                     | 81,051,564.26                    |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 16,820,604.68                  | 22,973,819.76                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 50,829.50                      | 20,933.03                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 2,058,445,105.13               | 2,695,045,274.45                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | 299,399,150.90                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 1,315,473.01                   | 909,158.23                       |
| 应付管理人报酬         |            | 2,075,585.58                   | 2,448,978.27                     |
| 应付托管费           |            | 345,930.94                     | 408,163.04                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 109,347.65                     | 293,526.67                       |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | 51,617.20                        |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 221,617.42                     | 170,382.67                       |
| 负债合计            |            | 4,067,954.60                   | 303,680,976.98                   |
| <b>所有者权益：</b>   |            | -                              | -                                |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,023,982,775.66               | 2,357,151,275.47                 |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 30,394,374.87                  | 34,213,022.00                    |
| 所有者权益合计         |            | 2,054,377,150.53               | 2,391,364,297.47                 |
| 负债和所有者权益总计      |            | 2,058,445,105.13               | 2,695,045,274.45                 |

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.015 元，基金份额总额

2,023,982,775.66 份

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银招财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                         | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 3 日(基<br>金合同生效日) 至<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>16,630,032.17</b>                     | <b>-1,831,369.38</b>  |
| 1.利息收入                     |          | 33,090,879.17                            | 3,218,641.56  |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 7,566,097.37                             | 1,452,971.15  |
| 债券利息收入                     |          | 24,043,128.25                            | 294,353.28  |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 1,481,653.55                             | 1,471,317.13  |
| 其他利息收入                     |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | -15,249,973.54                           | 2,306,805.40  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | -7,573,600.29                            | 2,669,427.14  |
| 基金投资收益                     |          | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | -942,866.21                              | -167,932.16   |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益                    |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -6,805,709.85                            | -256,526.67   |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 72,202.81                                | 61,837.09   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -2,177,168.09                            | -7,356,816.34   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 966,294.63                               | -   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>17,334,195.28</b>                     | <b>3,120,526.25</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 13,485,761.97                            | 2,310,363.74  |
| 2. 托管费                     |          | 2,247,626.95                             | 385,060.62  |
| 3. 销售服务费                   |          | -  | -   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 840,917.86                               | 390,477.53  |
| 5. 利息支出                    |          | 557,010.41                               | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 557,010.41                               | -   |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 202,878.09                               | 34,624.36   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-704,163.11</b>                       | <b>-4,951,895.63</b>  |

|                          |  |                    |                      |
|--------------------------|--|--------------------|----------------------|
| 减：所得税费用                  |  | -                  | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b> |  | <b>-704,163.11</b> | <b>-4,951,895.63</b> |

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，因此本报告上年度可比期间为 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银招财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（基金净值）                        | 2,357,151,275.47                                    | 34,213,022.00 | 2,391,364,297.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -704,163.11   | -704,163.11      |
| 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）      | -333,168,499.81                                     | -3,114,484.02 | -336,282,983.83  |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,360,061.13  | 12,271.64     | 2,372,332.77     |
| 2.基金赎回款                                | -335,528,560.94                                     | -3,126,755.66 | -338,655,316.60  |
| 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）                        | 2,023,982,775.66                                    | 30,394,374.87 | 2,054,377,150.53 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 3 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）                        | 2,604,299,055.26                                    | 0.00          | 2,604,299,055.26 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -4,951,895.63 | -4,951,895.63    |
| 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)                        | 2,604,299,055.26 | -4,951,895.63 | 2,599,347,159.63 |

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，因此本报告上年度可比期间为 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 6 月 30 日。

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

国投瑞银招财保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]655 号文《关于准予国投瑞银招财保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 6 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 2,604,299,055.26 份基金份额。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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）、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）。

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订

的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **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 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 06 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**

本基金本报告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**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金于本期未发生会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 印花税**

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **6.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税**

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品、买断式买入返售金融商品及持有金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 25,581,136.26          |
| 定期存款           | 400,000,000.00         |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 存款期限 3 个月-1 年  | 400,000,000.00         |
| 存款期限 1 个月以内    | -                      |

|      |                |
|------|----------------|
| 其他存款 | -              |
| 合计   | 425,581,136.26 |

注：1、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2、本基金本期未发生定期存款提前支取。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2016年6月30日 |                  |                  |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
|                   | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票                | 33,270,219.69     | 37,197,999.37    | 3,927,779.68     |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -                | -                |
| 债券                | 交易所市场             | 132,098,557.78   | 133,302,624.80   |
|                   | 银行间市场             | 1,401,601,067.07 | 1,404,934,000.00 |
|                   | 合计                | 1,533,699,624.85 | 1,538,236,624.80 |
| 资产支持证券            | -                 | -                | -                |
| 基金                | -                 | -                | -                |
| 其他                | -                 | -                | -                |
| 合计                | 1,566,969,844.54  | 1,575,434,624.17 | 8,464,779.63     |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2016年6月30日 |      |    |    |
|--------|-------------------|------|----|----|
|        | 合同/名义<br>金额       | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                   | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具 | -                 | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具 | -                 | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具 | -                 | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -3,652,320.00     | -    | -  | -  |
| 合计     | -3,652,320.00     | -    | -  | -  |

注：衍生金融资产/负债项下的其他衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 4,256.28               |
| 应收定期存款利息   | 366,981.23             |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 27.47                  |
| 应收债券利息     | 16,434,634.40          |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | 6.04                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 14,699.26              |
| 合计         | 16,820,604.68          |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 103,576.99             |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,770.66               |
| 合计          | 109,347.65             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 7,465.24               |
| 信息披露费       | 159,452.08             |
| 审计费用        | 54,700.10              |
| 合计          | 221,617.42             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,357,151,275.47                      | 2,357,151,275.47 |
| 本期申购          | 2,360,061.13                          | 2,360,061.13     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -335,528,560.94                       | -335,528,560.94  |

|     |                  |                  |
|-----|------------------|------------------|
| 本期末 | 2,023,982,775.66 | 2,023,982,775.66 |
|-----|------------------|------------------|

注：申购包含红利再投、基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 23,161,275.63 | 11,051,746.37 | 34,213,022.00 |
| 本期利润           | 1,473,004.98  | -2,177,168.09 | -704,163.11   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,435,783.86 | -678,700.16   | -3,114,484.02 |
| 其中：基金申购款       | 10,516.78     | 1,754.86      | 12,271.64     |
| 基金赎回款          | -2,446,300.64 | -680,455.02   | -3,126,755.66 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 22,198,496.75 | 8,195,878.12  | 30,394,374.87 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 212,288.52                 |
| 定期存款利息收入  | 7,317,060.19               |
| 其他存款利息收入  | 14,656.28                  |
| 结算备付金利息收入 | 22,092.38                  |
| 其他        | -                          |
| 合计        | 7,566,097.37               |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 308,162,426.06             |
| 减：卖出股票成本总额 | 315,736,026.35             |
| 买卖股票差价收入   | -7,573,600.29              |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,219,711,346.66           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,197,284,337.34           |
| 减：应收利息总额               | 23,369,875.53              |

|          |             |
|----------|-------------|
| 买卖债券差价收入 | -942,866.21 |
|----------|-------------|

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 股指期货投资收益 | -6,805,709.85              |

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 72,202.81                  |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 72,202.81                  |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 415,982.06                 |
| ——股票投资     | 752,813.00                 |
| ——债券投资     | -336,830.94                |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——基金投资     | -                          |
| ——贵金属投资    | -                          |
| ——其他       | -                          |
| 2.衍生工具     | -2,593,150.15              |
| ——权证投资     | -                          |
| ——股指期货     | -2,593,150.15              |
| 4.其他       | -                          |
| 合计         | -2,177,168.09              |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 957,018.99                 |
| 基金转换费收入 | 9,275.64                   |
| 合计      | 966,294.63                 |

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 835,348.76                 |

|           |            |
|-----------|------------|
| 银行间市场交易费用 | 5,569.10   |
| 合计        | 840,917.86 |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 54,700.10                  |
| 信息披露费    | 99,452.08                  |
| 银行汇划费用   | 27,077.41                  |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00                  |
| 其他费用     | 3,648.50                   |
| 合计       | 202,878.09                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告送出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 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<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年6月3日（基金合<br>同生效日）至2015年6<br>月30日 |
|----|--------------------------------|--|
|    |                                |  |



|                 |               |              |
|-----------------|---------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,485,761.97 | 2,310,363.74 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,610,709.51  | 1,122,899.70 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐累至月末按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首日起 3 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、公休等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 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<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年6月3日（基金合<br>同生效日）至2015年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,247,626.95                   | 385,060.62                                       |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按基金财产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计算，逐累至月末按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首日起 3 个工作日内从支取。若遇法定节假日、公休等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间本基金基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除本基金基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**6.4.10.5 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<br>30日 |               | 上年度可比期间<br>2015年6月3日（基金合同生<br>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                     | 25,581,136.26 | 212,288.52                                   | 28,871.11 |

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

**6.4.11 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.11.1 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

| 6.4.11.1.1 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       |
| 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    |

**6.4.11.2 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      |
|--------|------|--------|------|--------|-------|--------|-----------|-------------|-------------|
| 000966 | *ST煤 | 2015-1 | 重大事  | 8.71   | 2016- | 9.06   | 615,000.0 | 4,796,512.0 | 5,356,650.0 |

|        |      |            |            |       |            |       |           |            |            |
|--------|------|------------|------------|-------|------------|-------|-----------|------------|------------|
| 8      | 气    | 2-24       | 项          |       | 07-07      |       | 0         | 0          | 0          |
| 601611 | 中国核建 | 2016-06-30 | 股票交易异常波动停牌 | 20.92 | 2016-07-01 | 23.01 | 37,059.00 | 128,594.73 | 775,274.28 |

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 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。

#### 6.4.11.3.2 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。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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）、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）。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准

的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券市值的 10%。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 69.04%。

#### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2016年6月30日 | 上年末<br>2015年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 320,615,000.00    | 301,916,000.00     |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 1,090,187,000.00  | 1,188,344,316.00   |
| 合计     | 1,410,802,000.00  | 1,490,260,316.00   |

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票和部分短期融资券。

3.债券投资以净价列示。

#### 6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2016年6月30日 | 上年末<br>2015年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 87,547,797.10     | 93,182,810.10      |
| AAA 以下 | 19,494,827.70     | 16,402,042.96      |
| 未评级    | 20,392,000.00     | 20,002,000.00      |
| 合计     | 127,434,624.80    | 129,586,853.06     |

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3.债券投资以净价列示。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现

困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人持续进行本基金的流动性需求分析，构建投资组合时，对备选证券进行流动性检验，并以适度分散策略保持组合流动性，严格控制缺乏流动性资产的比例。同时通过独立的风险管理部门设定基金的流动性比例控制要求，对现金类资产配置策略、证券集中度、重仓证券的流动性以及冲击成本率、换手率和交易活跃度等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。于本期末，基金除附注列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### **6.4.12.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.12.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人执行灵活的利率管理策略规避利率风险，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2016 年 6 月 30<br>日 | 1 年以内            | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息           | 合计               |
|---------------------------|------------------|---------------|-------|---------------|------------------|
| 资产                        |                  |               |       |               |                  |
| 银行存款                      | 425,581,136.26   | -             | -     | -             | 425,581,136.26   |
| 结算备付金                     | 38,564,393.49    | -             | -     | -             | 38,564,393.49    |
| 存出保证金                     | 1,581,263.63     | -             | -     | -             | 1,581,263.63     |
| 交易性金融资产                   | 1,454,178,493.40 | 84,058,131.40 | -     | 37,197,999.37 | 1,575,434,624.17 |
| 衍生金融资产                    | -                | -             | -     | -             | -                |
| 买入返售金融资产                  | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应收证券清算款                   | -                | -             | -     | 412,253.40    | 412,253.40       |
| 应收利息                      | -                | -             | -     | 16,820,604.68 | 16,820,604.68    |
| 应收股利                      | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应收申购款                     | -                | -             | -     | 50,829.50     | 50,829.50        |
| 递延所得税资产                   | -                | -             | -     | -             | -                |
| 其他资产                      | -                | -             | -     | -             | -                |
| 资产总计                      | 1,919,905,286.78 | 84,058,131.40 | -     | 54,481,686.95 | 2,058,445,105.13 |
| 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                   | -                | -             | -     | 22,800.00     | 22,800.00        |
| 应付赎回款                     | -                | -             | -     | 1,315,473.01  | 1,315,473.01     |
| 应付管理人报酬                   | -                | -             | -     | 2,075,585.58  | 2,075,585.58     |

|                     |                  |               |               |                |                  |
|---------------------|------------------|---------------|---------------|----------------|------------------|
| 应付托管费               | -                | -             | -             | 345,930.94     | 345,930.94       |
| 应付销售服务费             | -                | -             | -             | -              | -                |
| 应付交易费用              | -                | -             | -             | 109,347.65     | 109,347.65       |
| 应交税费                | -                | -             | -             | -              | -                |
| 应付利息                | -                | -             | -             | -              | -                |
| 应付利润                | -                | -             | -             | -              | -                |
| 递延所得税负债             | -                | -             | -             | -              | -                |
| 其他负债                | -                | -             | -             | 221,617.42     | 221,617.42       |
| 负债总计                | -                | -             | -             | 4,090,754.60   | 4,090,754.60     |
| 利率敏感度缺口             | 1,919,905,286.78 | 84,058,131.40 | -             | 50,390,932.35  | 2,054,354,350.53 |
| 上年度末<br>2015年12月31日 | 1年以内             | 1-5年          | 5年以上          | 不计息            | 合计               |
| 资产                  |                  |               |               |                |                  |
| 银行存款                | 56,210,374.17    | -             | -             | -              | 56,210,374.17    |
| 结算备付金               | 27,023,412.91    | -             | -             | -              | 27,023,412.91    |
| 存出保证金               | 58,043,217.68    | -             | -             | -              | 58,043,217.68    |
| 交易性金融资产             | 1,530,889,643.00 | 61,872,844.70 | 27,084,681.36 | 149,992,654.07 | 1,769,839,823.13 |
| 衍生金融资产              | -                | -             | -             | -              | -                |
| 买入返售金融资产            | 679,882,129.51   | -             | -             | -              | 679,882,129.51   |
| 应收证券清算款             | -                | -             | -             | 81,051,564.26  | 81,051,564.26    |
| 应收利息                | -                | -             | -             | 22,973,819.76  | 22,973,819.76    |
| 应收申购款               | 19,940.18        | -             | -             | 992.85         | 20,933.03        |
| 资产总计                | 2,352,068,717.45 | 61,872,844.70 | 27,084,681.36 | 254,019,030.94 | 2,695,045,274.45 |
| 负债                  |                  |               |               |                |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 299,399,150.90   | -             | -             | -              | 299,399,150.90   |

|         |                  |               |               |                |                  |
|---------|------------------|---------------|---------------|----------------|------------------|
| 应付赎回款   | -                | -             | -             | 909,158.23     | 909,158.23       |
| 应付管理人报酬 | -                | -             | -             | 2,448,978.27   | 2,448,978.27     |
| 应付托管费   | -                | -             | -             | 408,163.04     | 408,163.04       |
| 应付交易费用  | -                | -             | -             | 293,526.67     | 293,526.67       |
| 应付利息    | -                | -             | -             | 51,617.20      | 51,617.20        |
| 其他负债    | -                | -             | -             | 170,382.67     | 170,382.67       |
| 负债总计    | 299,399,150.90   | -             | -             | 4,281,826.08   | 303,680,976.98   |
| 利率敏感度缺口 | 2,052,669,566.55 | 61,872,844.70 | 27,084,681.36 | 249,737,204.86 | 2,391,364,297.47 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|               |   |                             |                     |
|---------------|---|-----------------------------|---------------------|
| 假设            | 下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。 |                             |                     |
| 分析            | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                     |
|               |   | 本期末<br>2016年6月30日           | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|               | 市场利率下降 25 个基点   | 1,736,188.45                | 1,908,686.17        |
| 市场利率上升 25 个基点 | -1,724,843.96   | -1,897,954.68               |                     |

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的



决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                              |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基<br>金资<br>产净<br>值比<br>例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 37,197,999.37          | 1.81                     | 149,992,654.07           | 6.27                         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,538,236,624.8<br>0   | 74.88                    | 1,619,847,169.0<br>6     | 67.74                        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 其他            | 0                      | 0                        | -                        | -                            |
| 合计            | 1,575,434,624.1<br>7   | 76.69                    | 1,769,839,823.1<br>3     | 74.01                        |

注：其他价格风险敞口中其他项主要涉及股指期货投资。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |   |                             |                          |
|----|---|-----------------------------|--------------------------|
| 假设 | 本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。 |                             |                          |
| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |   | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 基金业绩比较基准增加 5%   | -164,128,997.82             | 171,333,230.11           |
|    | 基金业绩比较基准减少 5%   | 164,128,997.82              | -171,333,230.11          |

注：基金业绩比较基准=两年期银行定期存款收益率(税后)。

#### 6.4.13 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              | 37,197,999.37    | 1.81          |
|    | 其中：股票             | 37,197,999.37    | 1.81          |
| 2  | 固定收益投资            | 1,538,236,624.80 | 74.73         |
|    | 其中：债券             | 1,538,236,624.80 | 74.73         |
|    | 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          | -                | -             |
|    | 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      | 464,145,529.75   | 22.55         |
| 7  | 其他各项资产            | 18,864,951.21    | 0.92          |

|   |    |                  |        |
|---|----|------------------|--------|
| 8 | 合计 | 2,058,445,105.13 | 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              | 5,356,650.00  | 0.26          |
| C  | 制造业              | 5,695,626.39  | 0.28          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,992,000.00  | 0.49          |
| E  | 建筑业              | 775,274.28    | 0.04          |
| F  | 批发和零售业           | 6,195,000.00  | 0.30          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,124,663.00  | 0.20          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,703,659.60  | 0.13          |
| J  | 金融业              | -             | -             |
| K  | 房地产业             | 2,335,000.00  | 0.11          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 20,126.10     | 0.00          |
| 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               | 37,197,999.37 | 1.81          |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600900 | 长江电力   | 800,000.00   | 9,992,000.00 | 0.49         |
| 2  | 601933 | 永辉超市   | 1,500,000.00 | 6,195,000.00 | 0.30         |
| 3  | 000968 | *ST 煤气 | 615,000.00   | 5,356,650.00 | 0.26         |
| 4  | 600781 | 辅仁药业   | 300,000.00   | 5,229,000.00 | 0.25         |
| 5  | 300508 | 维宏股份   | 10,383.00    | 2,642,473.50 | 0.13         |
| 6  | 600159 | 大龙地产   | 500,000.00   | 2,335,000.00 | 0.11         |
| 7  | 000429 | 粤高速 A  | 375,209.00   | 2,063,649.50 | 0.10         |
| 8  | 600125 | 铁龙物流   | 323,550.00   | 2,061,013.50 | 0.10         |
| 9  | 601611 | 中国核建   | 37,059.00    | 775,274.28   | 0.04         |
| 10 | 601127 | 小康股份   | 8,662.00     | 206,761.94   | 0.01         |
| 11 | 603131 | 上海沪工   | 1,263.00     | 76,664.10    | 0.00         |
| 12 | 300515 | 三德科技   | 1,355.00     | 63,508.85    | 0.00         |
| 13 | 300518 | 盛讯达    | 1,306.00     | 61,186.10    | 0.00         |
| 14 | 002799 | 环球印务   | 1,080.00     | 47,131.20    | 0.00         |
| 15 | 603958 | 哈森股份   | 2,372.00     | 34,394.00    | 0.00         |
| 16 | 002802 | 洪汇新材   | 1,629.00     | 24,565.32    | 0.00         |
| 17 | 603909 | 合诚股份   | 1,095.00     | 20,126.10    | 0.00         |
| 18 | 603016 | 新宏泰    | 1,602.00     | 13,600.98    | 0.00         |

### 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  | 600159 | 大龙地产 | 12,504,998.92 | 0.52           |
| 2  | 002727 | 一心堂  | 12,204,839.30 | 0.51           |
| 3  | 000908 | 景峰医药 | 10,327,355.79 | 0.43           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 4  | 600900 | 长江电力 | 9,900,136.59 | 0.41 |
| 5  | 600594 | 益佰制药 | 9,678,889.52 | 0.40 |
| 6  | 000959 | 首钢股份 | 9,295,355.00 | 0.39 |
| 7  | 601933 | 永辉超市 | 8,436,613.50 | 0.35 |
| 8  | 600085 | 同仁堂  | 7,540,203.86 | 0.32 |
| 9  | 600781 | 辅仁药业 | 6,674,565.00 | 0.28 |
| 10 | 600485 | 信威集团 | 5,952,209.00 | 0.25 |
| 11 | 601888 | 中国国旅 | 5,713,048.00 | 0.24 |
| 12 | 002611 | 东方精工 | 4,764,727.90 | 0.20 |
| 13 | 000703 | 恒逸石化 | 4,762,859.44 | 0.20 |
| 14 | 600998 | 九州通  | 4,762,815.00 | 0.20 |
| 15 | 300161 | 华中数控 | 4,762,590.10 | 0.20 |
| 16 | 300273 | 和佳股份 | 4,760,518.00 | 0.20 |
| 17 | 300304 | 云意电气 | 4,743,858.81 | 0.20 |
| 18 | 603308 | 应流股份 | 4,739,605.00 | 0.20 |
| 19 | 600036 | 招商银行 | 4,636,917.00 | 0.19 |
| 20 | 002009 | 天奇股份 | 4,560,545.08 | 0.19 |

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  | 600028 | 中国石化 | 19,440,000.00 | 0.81           |
| 2  | 600159 | 大龙地产 | 15,280,145.69 | 0.64           |
| 3  | 000625 | 长安汽车 | 11,358,893.69 | 0.47           |
| 4  | 000089 | 深圳机场 | 11,177,077.68 | 0.47           |
| 5  | 002727 | 一心堂  | 10,724,587.00 | 0.45           |
| 6  | 000959 | 首钢股份 | 10,709,319.00 | 0.45           |
| 7  | 600594 | 益佰制药 | 10,164,953.20 | 0.43           |
| 8  | 000908 | 景峰医药 | 10,084,085.04 | 0.42           |
| 9  | 600885 | 宏发股份 | 9,973,387.30  | 0.42           |
| 10 | 000028 | 国药一致 | 9,934,544.17  | 0.42           |
| 11 | 002627 | 宜昌交运 | 7,808,878.46  | 0.33           |
| 12 | 600085 | 同仁堂  | 7,799,379.00  | 0.33           |
| 13 | 600332 | 白云山  | 6,796,437.36  | 0.28           |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 6,640,000.00  | 0.28           |
| 15 | 000488 | 晨鸣纸业 | 6,523,219.57  | 0.27           |
| 16 | 000800 | 一汽轿车 | 5,892,342.00  | 0.25           |
| 17 | 601888 | 中国国旅 | 5,762,279.34  | 0.24           |
| 18 | 600485 | 信威集团 | 5,754,801.00  | 0.24           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,742,914.00 | 0.24 |
| 20 | 600115 | 东方航空 | 5,419,605.00 | 0.23 |

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 | 202,188,558.65 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 308,162,426.06 |

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      | 89,514,000.00    | 4.36         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,392,000.00    | 1.48         |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,392,000.00    | 1.48         |
| 4  | 企业债券      | 29,333,213.90    | 1.43         |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,202,516,000.00 | 58.53        |
| 6  | 中期票据      | 63,254,000.00    | 3.08         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 14,455,410.90    | 0.70         |
| 8  | 同业存单      | 108,772,000.00   | 5.29         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,538,236,624.80 | 74.88        |

### 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 | 011606001 | 16 电网 SCP001  | 1,500,000 | 150,255,000.00 | 7.31    |
| 2 | 041554043 | 15 长电 CP001   | 1,000,000 | 100,610,000.00 | 4.90    |
| 3 | 020118    | 16 贴债 20      | 800,000   | 79,568,000.00  | 3.87    |
| 4 | 011599749 | 15 人福 SCP001  | 500,000   | 50,285,000.00  | 2.45    |
| 5 | 011595004 | 15 中化工 SCP004 | 500,000   | 50,235,000.00  | 2.45    |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

| 代码             | 名称                  | 持仓量 | 合约市值          | 公允价值变动    | 风险说明          |
|----------------|---------------------|-----|---------------|-----------|---------------|
| IF1609         | 沪深 300 股指期货 1609 合约 | -4  | -3,652,320.00 | 22,800.00 | -             |
| 公允价值变动总额合计     |                     |     |               |           | 22,800.00     |
| 股指期货投资本期收益     |                     |     |               |           | -6,805,709.85 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 |                     |     |               |           | -2,593,150.15 |

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为了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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 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   | 1,581,263.63  |
| 2  | 应收证券清算款 | 412,253.40    |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 16,820,604.68 |
| 5  | 应收申购款   | 50,829.50     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 18,864,951.21 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 123001 | 蓝标转债 | 394,182.00 | 0.02         |

#### 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 | 占基金资产 | 流通受限 |
|----|------|------|--------|-------|------|
|----|------|------|--------|-------|------|



|   |        |        | 的公允价值        | 净值比例(%) | 情况说明               |
|---|--------|--------|--------------|---------|--------------------|
| 1 | 000968 | *ST 煤气 | 5,356,650.00 | 0.26    | 重大事项<br>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<br>异常波动<br>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<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 12,376   | 163,540.95    | 19,999,900.00 | 0.99%      | 2,003,982,875.66 | 99.01%     |

### 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 | 11,119.46 | 0.00%    |

### 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<br>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                      | 0                 |

|           |  |
|-----------|--|
| <b>基金</b> |  |
|-----------|--|

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 6 月 3 日）基金份额总额 | 2,604,299,055.26 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 2,357,151,275.47 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 2,360,061.13     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 335,528,560.94   |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 2,023,982,775.66 |

## 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安永华明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 |            |
|--------|--------|----------------|--------------|-----------|------------|
|        |        | 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 |
| 中信建投   | 1      | 102,317,506.97 | 20.12%       | 95,288.61 | 20.12%     |
| 国泰君安   | 1      | 84,246,333.82  | 16.57%       | 78,459.08 | 16.57%     |
| 中信证券   | 2      | 77,459,266.75  | 15.23%       | 72,137.97 | 15.23%     |
| 申万宏源证券 | 1      | 58,835,053.50  | 11.57%       | 54,793.01 | 11.57%     |
| 东北证券   | 1      | 35,827,045.58  | 7.05%        | 33,365.97 | 7.05%      |
| 华泰证券   | 1      | 23,629,186.50  | 4.65%        | 22,005.89 | 4.65%      |
| 中金公司   | 1      | 20,798,413.74  | 4.09%        | 19,369.63 | 4.09%      |
| 东方证券   | 1      | 19,821,619.98  | 3.90%        | 18,459.87 | 3.90%      |
| 第一创业   | 1      | 17,811,015.04  | 3.50%        | 16,587.19 | 3.50%      |
| 长江证券   | 1      | 14,826,317.24  | 2.92%        | 13,807.76 | 2.92%      |
| 银河证券   | 1      | 13,926,408.77  | 2.74%        | 12,969.59 | 2.74%      |
| 广发证券   | 1      | 11,922,040.26  | 2.34%        | 11,102.93 | 2.34%      |
| 平安证券   | 1      | 9,240,375.50   | 1.82%        | 8,605.51  | 1.82%      |
| 招商证券   | 1      | 7,181,927.00   | 1.41%        | 6,688.54  | 1.41%      |
| 国信证券   | 1      | 5,036,455.00   | 0.99%        | 4,690.49  | 0.99%      |
| 广州证券   | 1      | 3,312,201.00   | 0.65%        | 3,084.69  | 0.65%      |
| 联讯证券   | 1      | 2,089,255.47   | 0.41%        | 1,945.74  | 0.41%      |
| 安信证券   | 1      | 204,780.64     | 0.04%        | 190.71    | 0.04%      |

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           |              |
|--------|---------------|--------------|----------------|--------------|
|        | 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 |
| 中信建投   | 10,337,549.73 | 38.96%       | 173,000,000.00 | 10.48%       |
| 中信证券   | 4,791,230.66  | 18.06%       | 274,000,000.00 | 16.60%       |
| 申万宏源证券 | 570,568.00    | 2.15%        | -              | -            |
| 东北证券   | 3,647,256.99  | 13.75%       | 160,000,000.00 | 9.70%        |
| 华泰证券   | 510,443.56    | 1.92%        | -              | -            |
| 中金公司   | 964,517.26    | 3.64%        | 88,000,000.00  | 5.33%        |
| 东方证券   | 782,400.00    | 2.95%        | -              | -            |
| 第一创业   | 2,604,948.75  | 9.82%        | -              | -            |
| 长江证券   | 113,040.00    | 0.43%        | -              | -            |
| 银河证券   | -             | -            | 340,300,000.00 | 20.62%       |
| 平安证券   | -             | -            | 60,000,000.00  | 3.64%        |
| 招商证券   | 2,210,200.00  | 8.33%        | 555,000,000.00 | 33.63%       |

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、本报告期内本基金未发生交易所权证交易。

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。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                | 法定披露日期     |
|----|--|-----------------------|------------|
| 1  | 报告期内基金管理人对于指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间进行公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2016-01-06 |
| 2  | 报告期内基金管理人对本基金基金经理变更进行公告                | 证券时报、上海证券报            | 2016-01-19 |
| 3  | 报告期内基金管理人对于国投瑞银网上直销转账汇款买基金认、申购费率优惠进    | 上海证券报、中国证券报、证券时报      | 2016-01-28 |

|   |  |                  |            |
|---|--|------------------|------------|
|   | 行公告  |                  |            |
| 4 | 报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更情况进行公告               | 证券时报             | 2016-02-05 |
| 5 | 报告期内基金管理人对董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况进行公告 | 证券时报             | 2016-03-23 |
| 6 | 报告期内基金管理人对本基金基金经理变更进行公告                    | 证券时报、上海证券报       | 2016-04-15 |
| 7 | 报告期内基金管理人对淘宝店关闭申购类服务进行公告                   | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016-05-05 |
| 8 | 报告期内基金管理人对网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务进行公告            | 上海证券报、中国证券报、证券时报 | 2016-05-05 |
| 9 | 报告期内基金管理人对从业人员在子公司兼职情况进行公告                 | 证券时报             | 2016-05-31 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银招财保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]655 号）

《关于国投瑞银招财保本混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2015]1683 号）

《国投瑞银招财保本混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银招财保本混合型证券投资基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银招财保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告原文

### 11.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日