# 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告

2019-06-30

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019-08-26


目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金简介
  - 基金基本情况
  - 基金产品说明
  - 基金管理人和基金托管人
  - 信息披露方式
  - 其他相关资料
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要会计数据和财务指标
  - 基金净值表现
    - 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
    - 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
- 管理人报告
  - 基金管理人及基金经理情况
    - 基金管理人及其管理基金的经验
    - 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明


## 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。

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2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，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2019年1月1日起至2019年6月30日止。

## 基金基本情况

| 项目 | 数值 | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银证券瑞益混合 | |
| 场内简称 | | |
| 基金主代码 | 003980 | |
| 基金运作方式 | 契约型，定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017-01-25 | |
| 基金管理人 | 中银国际证券股份有限公司 | |
| 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 | | 51,445,092.84 |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属2级基金的基金简称 | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C |
| 下属2级基金的场内简称 | | |
| 下属2级基金的交易代码 | 003980 | 003981 |
| 报告期末下属2级基金的份额总额 | 45,036,867.46 | 6,408,225.38 |

## 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过资产配置策略、股票投资策略、权证投资策略 、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略及股指期货投资策略，以实现基金资产的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×40%＋中债综合全价指数收益率×60% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等收益风险特征的投资品种。 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | |

## 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 | | 中银国际证券股份有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵向雷 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-20328000 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | gmkf@bocichina.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 021-61195566,400-620-8888 | 95533 |
| 传真 | | 021-50372474 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 宁敏 | 田国立 |

## 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.bocifunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人办公地址 |

## 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 中银国际证券股份有限公司 | 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 |

## 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 报告期 | 报告期(2019-01-01 至 2019-06-30) | | |
|---|---|---|---|
| | 中银证券瑞益混合 | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C |
| 本期已实现收益 | | 4,411,720.10 | 900,983.67 |
| 本期利润 | | 7,620,276.20 | 2,499,526.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | | 0.1831 | 0.2681 |
| 本期加权平均净值利润率 | -% | 16.77 % | 24.89 % |
| 本期基金份额净值增长率 | -% | 16.86 % | 16.58 % |
| 报告期末 | 报告期末(2019-06-30) | | |
| | 中银证券瑞益混合 | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C |
| 期末可供分配利润 | | 4,469,905.80 | 548,902.70 |
| 期末可供分配基金份额利润 | | 0.0992 | 0.0857 |
| 期末基金资产净值 | | 49,506,773.26 | 6,957,128.08 |
| 期末基金份额净值 | | 1.0992 | 1.0857 |
| 报告期末 | 报告期末(2019-06-30) | | |
| | 中银证券瑞益混合 | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C |
| 基金份额累计净值增长率 | -% | 9.92 % | 8.57 % |

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、期末可供分配利润是指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。

3、上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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 基金净值表现

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A

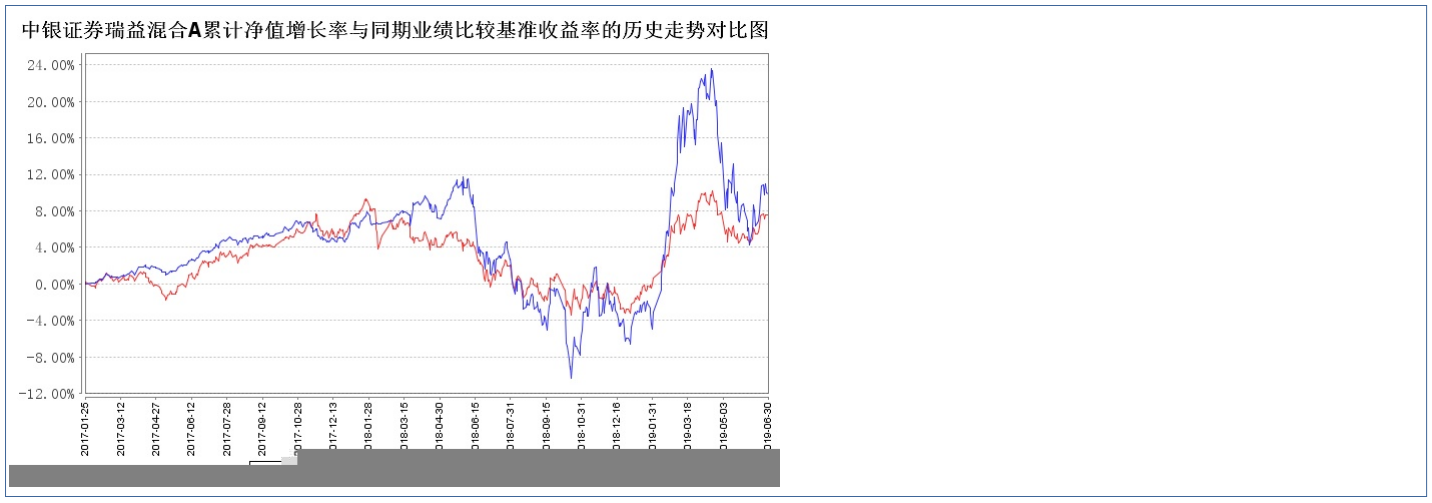
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 1.74 % | 1.15 % | 2.33 % | 0.45 % | -0.59 % | 0.70 % |
| 过去三个月 | -6.82 % | 1.55 % | -0.45 % | 0.60 % | -6.37 % | 0.95 % |
| 过去六个月 | 16.86 % | 1.47 % | 10.61 % | 0.61 % | 6.25 % | 0.86 % |
| 过去一年 | 6.25 % | 1.28 % | 5.98 % | 0.60 % | 0.27 % | 0.68 % |
| 自基金合同生效起至今 | 9.92 % | 0.87 % | 7.53 % | 0.47 % | 2.39 % | 0.40 % |

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B

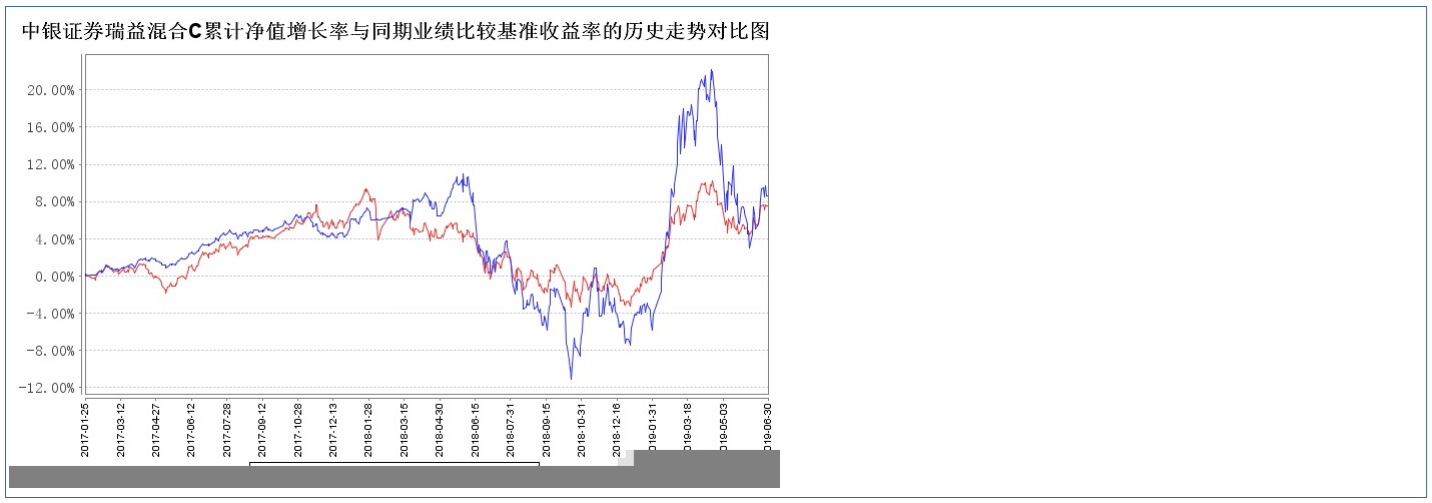
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 1.71 % | 1.15 % | 2.33 % | 0.45 % | -0.62 % | 0.70 % |
| 过去三个月 | -6.93 % | 1.55 % | -0.45 % | 0.60 % | -6.48 % | 0.95 % |
| 过去六个月 | 16.58 % | 1.47 % | 10.61 % | 0.61 % | 5.97 % | 0.86 % |
| 过去一年 | 5.76 % | 1.28 % | 5.98 % | 0.60 % | -0.22 % | 0.68 % |
| 自基金合同生效起至今 | 8.57 % | 0.87 % | 7.53 % | 0.47 % | 1.04 % | 0.40 % |

注：本基金合同于2017年1月25日生效，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%＋中债综合全价指数收益率×60%。

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A




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B




注：1、本基金合同于2017年1月25日生效；

## 基金管理人及基金经理情况

### 基金管理人及其管理基金的经验

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于2002年2月28日在上海成立，注册资本25亿元人民币。股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金（有限合伙）、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业（有限合伙）、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心（有限合伙）、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司。中银国际证券的经营范围包括：证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理业务、为期货公司提供中间介绍业务。截至2019年6月30日，本管理人共管理十七只证券投资基金，包括：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本1号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金。

### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王玉玺 | 本基金基金经理 | 2017-01-26 | - | 13 | 王玉玺，硕士研究生。2006年7月至2008年7月任职于中国农业银行资金运营部，担任交易员；2008年8月至2016年6月任职于中国农业银行金融市场部，担任交易员、高级交易员；2016年6月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券保本1号混合型证券投资基金基金经理，现任基金管理部副总经理、中银国际证券中国红债券宝投资主办人、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金基金经理。 |
| 张燕 | 本基金基金经理 | 2018-01-19 | - | 7 | 张燕，硕士研究生， 中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2011年7月至2015年5月任职新华基金管理有限公司研究部，担任基金经理助理兼研究员；2015年5月至2016年11月任职中欧基金管理有限公司事业部策略十组，担任基金经理；2016年11月至2017年10月任职中国人寿养老保险股份有限公司投资中心，担任高级权益投资经理。2017年10月加盟中银国际证券股份有限公司，历任中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。
报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。
报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

### 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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。
本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，年初贸易战缓和叠加国内政策面出现了一些积极的变化，市场在风险偏好提升的带动下大幅反弹；随后贸易摩擦等使得市场在前期估值明显提升后明显回撤。市场表现上，年初到四月中旬市场普涨，风险偏好明显提升，四月中旬到六月底，市场总体调整明显，但食品饮料为代表的消费板块和金融板块逆势上涨，优质白马股齐创历史新高。上证综指、沪深300以及创业板分别上涨19.45%、27.07%、20.87%，市场呈现了普涨的行情。今年以来，本基金权益仓位较高,结构上主要配置低估值的价值股，底仓主要是低估值的大消费行业，同时兼顾了跌幅较大估值偏低景气度较好的成长板块以及阶段性配置了超跌的周期板块。消费板块对净值贡献较大。

**报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末中银证券瑞益混合A基金份额净值为1.0992元，本报告期基金份额净值增长率为16.86%；截至本报告期末中银证券瑞益混合C基金份额净值为1.0857元，本报告期基金份额净值增长率为16.58%；同期业绩比较基准收益率为10.61%。

## 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，随着各种内部及外部风险逐步暴露、目前释放较为充分，同时市场整体估值不高，很多板块估值处在历史低分位，而由于资金抱团板块有限导致估值洼地不少，因此我们预计后续市场的结构性机会可期。

## 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长，成员由基金管理部、业务营运部、内控与法律合规部、审计部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存在有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

## 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

中银证券瑞益混合A基金：本报告期内未实施利润分配。

中银证券瑞益混合C基金：本报告期内未实施利润分配。

## 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

## 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

## 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。

## 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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 托管人对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。

## 资产负债表

**会计主体：中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金**
**报告截止日：2019-06-30**

单位：人民币元

| 资产 | 本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| **资产：** | | |
| 银行存款 | 10,149,213.07 | 3,197,745.89 |
| 结算备付金 | 203,832.68 | 45,683.50 |
| 存出保证金 | 23,569.17 | 12,363.99 |
| 交易性金融资产 | 46,274,254.28 | 40,012,919.91 |
| 其中：股票投资 | 46,274,254.28 | 40,012,919.91 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 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 | - | 6,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | 1,999,222.59 |
| 应收利息 | 1,940.68 | -1,365.72 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 56,652,809.88 | 51,266,570.16 |
| **负债和所有者权益** | **本期末<br>2019-06-30** | **上年度末<br>2018-12-31** |
| **负债：** | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 27,309.43 | 26,649.59 |
| 应付托管费 | 4,551.58 | 4,441.61 |
| 应付销售服务费 | 2,804.59 | 4,808.52 |
| 应付交易费用 | 7,681.25 | 7,997.82 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 146,561.69 | 350,000.00 |
| 负债合计 | 188,908.54 | 393,897.54 |
| **所有者权益：** | - | - |
| 实收基金 | 51,445,092.84 | 54,201,563.45 |
| 未分配利润 | 5,018,808.50 | -3,328,890.83 |
| 所有者权益合计 | 56,463,901.34 | 50,872,672.62 |
| 负债和所有者权益总计 | 56,652,809.88 | 51,266,570.16 |

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额51,445,092.84份，其中中银证券瑞益混合A基金份额总额为45,036,867.46份，基金份额净值1.0992元；中银证券瑞益混合C基金份额总额为6,408,225.38份，基金份额净值1.0857元。

## 利润表

会计主体：中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 10,535,091.16 | 8,458,550.63 |
| 1.利息收入 | 87,892.15 | 4,059,887.35 |
| 其中：存款利息收入 | 28,881.03 | 42,570.57 |
| 债券利息收入 | - | 3,344,150.79 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 59,011.12 | 673,165.99 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 5,638,913.61 | -5,658,197.38 |
| 其中：股票投资收益 | 5,151,033.36 | -5,586,910.30 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | -352,880.86 |
| 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 | 487,880.25 | 281,593.78 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 4,807,098.72 | 10,056,860.66 |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 1,186.68 | - |
| 减：二、费用 | 415,288.67 | 1,691,562.35 |
| 1. 管理人报酬 | 163,323.90 | 557,512.92 |
| 2. 托管费 | 27,220.66 | 92,918.82 |
| 3. 销售服务费 | 24,642.72 | 12,549.42 |
| 4. 交易费用 | 143,082.45 | 296,792.14 |
| 5. 利息支出 | - | 521,962.49 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | 521,962.49 |
| 6. 税金及附加 | - | 5,732.89 |
| 7. 其他费用 | 57,018.94 | 204,093.67 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 10,119,802.49 | 6,766,988.28 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 10,119,802.49 | 6,766,988.28 |

## 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | | |
|---|---|---|---|
| | 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） | 54,201,563.45 | -3,328,890.83 | 50,872,672.62 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 10,119,802.49 | 10,119,802.49 |
| 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） | -2,756,470.61 | -1,772,103.16 | -4,528,573.77 |
| 其中：1.基金申购款 | 27,439,528.84 | 4,054,248.80 | 31,493,777.64 |
| 2.基金赎回款 | -30,195,999.45 | -5,826,351.96 | -36,022,351.41 |
| 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） | 51,445,092.84 | 5,018,808.50 | 56,463,901.34 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 | | |
|---|---|---|---|
| | 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） | 423,681,910.54 | 20,868,169.05 | 444,550,079.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 6,766,988.28 | 6,766,988.28 |
| 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） | -373,508,717.24 | -25,943,116.42 | -399,451,833.66 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,642,388.54 | 247,952.41 | 3,890,340.95 |
| 2.基金赎回款 | -377,151,105.78 | -26,191,068.83 | -403,342,174.61 |
| 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） | 50,173,193.30 | 1,692,040.91 | 51,865,234.21 |

本报告第6.1页至第6.4页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：宁敏　　主管会计工作负责人：沈锋　　会计机构负责人：戴景义

注：此处为PDF文件中的章节数或者页数。

## 报表附注

### 基金基本情况

中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2787号《关于准予中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中银国际证券股份有限公司(原“中银国际证券有限责任公司”，于2017年12月29日更名)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币635,118,770.52元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第052号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为635,243,530.39份基金份额，其中认购资金利息折合124,759.87份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但赎回时收取赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起至6个月月度对日的期间封闭运作，不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之日的下一个工作日(包括该日)起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期不少于5个工作日，并且最长不超过20个工作日，开放期的具体时间由基金管理人中银国际证券股份有限公司在每一开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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(含国家债券、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以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相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%－95%；封闭期内，股票资产占基金资产的比例为0%－100%；开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%＋中债综合全价指数收益率×60%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于2019年8月23日批准报出。

### 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》、《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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。

### 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年1月1日至2019年6月30日止期间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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 重要会计政策和会计估计

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 会计年度

-

### 记账本位币

-

### 金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

-

会计估计变更的说明

-

差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 10,149,213.07 | - |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - | - |
| 存款期限1-3个月 | - | - |
| 存款期限3个月以上 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 10,149,213.07 | 3,197,745.89 |

交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2019-06-30 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 48,964,810.37 | 46,274,254.28 | -2,690,556.09 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 48,964,810.37 | 46,274,254.28 | -2,690,556.09 |

| 项目 | | 上年度末<br>2018-12-31 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | - | - | - |

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 合同/名义金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 其中：国债期货投资 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 其中：远期外汇投资 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | - | - | - | - |
| 其中：股指期货投资 | - | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - |

| 项目 | 上年度末 2018-12-31 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 合同/名义金额 | 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 | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - |

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |

| 项目 | 上年度末 2018-12-31 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券代码 | 债券名称 | 约定返售日 | 估值单价 | 数量（张） | 估值总额 | 其中：已出售或再质押总额 |

| 项目 | 上年度末 2018-12-31 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券代码 | 债券名称 | 约定返售日 | 估值单价 | 数量（张） | 估值总额 | 其中：已出售或再质押总额 |

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | 上年度末 2018-12-31 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 1,848.61 | - |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 82.53 | - |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 9.54 | - |
| 合计 | 1,940.68 | -1,365.72 |

其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | 上年度末 2018-12-31 |
|---|---|---|
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | - | - |

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | 上年度末 2018-12-31 |
|---|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 7,681.25 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 7,681.25 | 7,997.82 |

其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | 上年度末 2018-12-31 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提费用 | 146,561.69 | - |
| 合计 | 146,561.69 | 350,000.00 |

实收基金

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 中银证券瑞益混合A | | 中银证券瑞益混合C | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 42,376,047.30 | 42,376,047.30 | 11,825,516.15 | 11,825,516.15 |
| 本期申购 | 24,095,643.53 | 24,095,643.53 | 3,343,885.31 | 3,343,885.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -21,434,823.37 | -21,434,823.37 | -8,761,176.08 | -8,761,176.08 |
| 本期末 | 45,036,867.46 | 45,036,867.46 | 6,408,225.38 | 6,408,225.38 |

注：本基金合同于2017年1月25日生效，基金合同生效日的基金份额总额为635,243,530.39份基金份额，其中认购资金利息折合124,759.87份基金份额。

未分配利润

中银证券瑞益混合A

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 | 3,091,276.78 | -5,607,746.18 | -2,516,469.40 |
| 本期利润 | 4,411,720.10 | 3,208,556.10 | 7,620,276.20 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 564,876.20 | -1,198,777.20 | -633,901.00 |
| 其中：基金申购款 | 3,390,126.16 | 243,198.47 | 3,633,324.63 |
| 基金赎回款 | -2,825,249.96 | -1,441,975.67 | -4,267,225.63 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 8,067,873.08 | -3,597,967.28 | 4,469,905.80 |

中银证券瑞益混合C

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 | 740,591.21 | -1,553,012.64 | -812,421.43 |
| 本期利润 | 900,983.67 | 1,598,542.62 | 2,499,526.29 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -584,667.80 | -553,534.36 | -1,138,202.16 |
| 其中：基金申购款 | 429,373.88 | -8,449.71 | 420,924.17 |
| 基金赎回款 | -1,014,041.68 | -545,084.65 | -1,559,126.33 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,056,907.08 | -508,004.38 | 548,902.70 |

存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 22,764.81 | - |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 5,166.53 | - |
| 其他 | 949.69 | - |
| 合计 | 28,881.03 | 42,570.57 |

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 55,529,765.90 | - |
| 减：卖出股票成本总额 | 50,378,732.54 | - |
| 买卖股票差价收入 | 5,151,033.36 | - |

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | - | -352,880.86 |

注：本基金本报告期无债券投资收益。

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | - | - |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | - | - |
| 减：应收利息总额 | - | - |
| 买卖债券差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 赎回基金份额对价总额 | - | - |
| 减：现金支付赎回款总额 | - | - |
| 减：赎回债券成本总额 | - | - |
| 减：赎回债券应收利息总额 | - | - |
| 赎回差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 申购基金份额对价总额 | - | - |
| 减：现金支付申购款总额 | - | - |
| 减：申购债券成本总额 | - | - |
| 减：申购债券应收利息总额 | - | - |
| 申购差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 卖出资产支持证券成交总额 | - | - |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | - | - |
| 减：应收利息总额 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入 | - | - |
| 贵金属投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 贵金属投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | - | - |

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 卖出贵金属成交总额 | - | - |
| 减：卖出贵金属成本总额 | - | - |
| 减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额 | - | - |
| 买卖贵金属差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 赎回贵金属份额对价总额 | - | - |
| 减：现金支付赎回款总额 | - | - |
| 减：赎回贵金属成本总额 | - | - |
| 赎回差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 申购贵金属份额总额 | - | - |
| 减：现金支付申购款总额 | - | - |
| 减：申购贵金属成本总额 | - | - |
| 申购差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 卖出权证成交总额 | - | - |
| 减：卖出权证成本总额 | - | - |
| 减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额 | - | - |
| 买卖权证差价收入 | - | - |

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间收益金额<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| - | - | - |

股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 487,880.25 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 487,880.25 | 281,593.78 |

公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 4,807,098.72 | - |
| ——股票投资 | 4,807,098.72 | - |
| ——债券投资 | - | - |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | 4,807,098.72 | 10,056,860.66 |

其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 1,186.68 | - |
| 合计 | 1,186.68 | - |

交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 143,082.45 | - |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 交易基金产生的费用 | - | - |
| 其中：申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 合计 | 143,082.45 | 296,792.14 |

其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 24,795.19 | - |
| 信息披露费 | 11,766.50 | - |
| 账户维护费 | 18,000.00 | - |
| 银行费用 | 1,857.25 | - |
| 其他 | 600.00 | - |
| 合计 | 57,018.94 | 204,093.67 |

分部报告

无。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的日后事项。

关联方关系

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

无。

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 |
|---|---|
| 中银国际证券股份有限公司（“中银证券”） | 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 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金管理人股东的控股股东、基金销售机构 |

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中银证券 | 106,769,108.36 | 100.00 % | 184,356,798.60 | 100.00 % |

债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中银证券 | - | -% | 85,209,075.77 | 100.00 % |

债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中银证券 | 484,300,000.00 | 100.00 % | 1,186,296,000.00 | 100.00 % |

权证交易

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中银证券 | 78,079.46 | 100.00 % | 7,681.25 | 100.00 % |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中银证券 | 134,810.55 | 100.00 % | 2,447.59 | 100.00 % |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 163,323.90 | 557,512.92 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 29,744.93 | 37,521.84 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H=E×0.60 %÷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
2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 27,220.66 | 92,918.82 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=E× 0.10%÷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

销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C | 合计 |
| 中国银行 | - | 2,240.80 | 2,240.80 |
| 中银证券 | - | 22,189.74 | 22,189.74 |
| 合计 | - | 24,430.54 | 24,430.54 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | | |
| | 当期应支付的销售服务费 | | |
| | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C | 合计 |
| 中国银行 | - | 1,598.64 | 1,598.64 |
| 中银证券 | - | 10,926.91 | 10,926.91 |
| 合计 | - | 12,525.55 | 12,525.55 |

注：本基金A 类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.50%÷当年天数
H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期 2019-01-01至2019-06-30 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018-01-01至2018-06-30 | | | | | |
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |

注：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）的交易。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 | |
|---|---|---|---|---|
| 份额级别 | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C | 中银证券瑞益混合A | 中银证券瑞益混合C |
| 基金合同生效日（2017-01-25）持有的基金份额 | 19,999,000.00 | - | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 2,039,675.36 | - | 19,999,000.00 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - | - | - |
| 期间因拆分增加的份额 | - | - | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 2,039,675.36 | - | - | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 4.5300 % | -% | -% | -% |

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

份额单位：份

| 项目 | 中银证券瑞益混合A | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 本期末<br>2019-06-30 | | 上年度末<br>2018-12-31 | |
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 项目 | 中银证券瑞益混合C | | | |
| | 本期末<br>2019-06-30 | | 上年度末<br>2018-12-31 | |
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

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>2019-01-01至2019-06-30 | | 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 建设银行 | 10,149,213.07 | 22,764.81 | 3,681,508.80 | 34,366.10 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期<br>2019-01-01至2019-06-30 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 上年度可比期间<br>2018-01-01至2018-06-30 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |

注：本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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需要说明。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金中银证券瑞益混合A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

利润分配情况——非货币市场基金中银证券瑞益混合C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|

注：本基金本报告期未进行利润分配。

期末（2019-06-30）本基金持有的流通受限证券

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

| 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

注：本基金本期末未有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

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（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

注：本基金本期末未有因暂时停牌等流通受限证券。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

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。

金融工具风险及管理

本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于中等收益风险特征的投资品种。本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括管理风险、技术风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层级风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、审计、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

注： 2019年6月30日，本基金未持有期限在一年内（含）的债券（2018年12月31日：同）。

按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

注： 2019年6月30日，本基金未持有期限在一年以内（含）的资产支持证券（2018年12月31日：同）。

按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

注： 2019年6月30日，本基金未持有期限在一年以内（含）的同业存单（2018年12月31日：同）。

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>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

注：2019年6月30日，本基金未持有期限大于一年的债券（2018年12月31日：同）。

按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

注：2019年6月30日，本基金未持有期限大于一年的资产支持证券（2018年12月31日：同）。

按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
|---|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

注：2019年6月30日，本基金未持有期限大于一年的同业存单（2018年12月31日：同）。

流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2019年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

| 本期末<br>2019-06-30 | 合计 |
|---|---|
| 资产 | |
| 资产总计 | - |
| 负债 | |
| 负债总计 | - |
| 流动性净额 | - |
| **上年度末<br>2018-12-31** | **合计** |
| 资产 | |
| 资产总计 | - |
| 负债 | |
| 负债总计 | - |
| 流动性净额 | - |

注：不适用。

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度；根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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。

利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等，因此存在相应的利率风险。

利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019-06-30 | 1年以内 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|
| 资产 | | | |
| 银行存款 | 10,149,213.07 | - | 10,149,213.07 |
| 结算备付金 | 203,832.68 | - | 203,832.68 |
| 存出保证金 | 23,569.17 | - | 23,569.17 |
| 交易性金融资产 | - | 46,274,254.28 | 46,274,254.28 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - |
| 应收利息 | - | 1,940.68 | 1,940.68 |
| 应收股利 | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - |
| 资产总计 | 10,376,614.92 | 46,276,194.96 | 56,652,809.88 |
| 负债 | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | 27,309.43 | 27,309.43 |
| 应付托管费 | - | 4,551.58 | 4,551.58 |
| 应付证券清算款 | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | 2,804.59 | 2,804.59 |
| 应付交易费用 | - | 7,681.25 | 7,681.25 |
| 应付利息 | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - |
| 其他负债 | - | 146,561.69 | 146,561.69 |
| 负债总计 | - | 188,908.54 | 188,908.54 |
| 利率敏感度缺口 | 10,376,614.92 | 46,087,286.42 | 56,463,901.34 |
| **上年度末<br>2018-12-31** | **1年以内** | **不计息** | **合计** |
| 资产 | | | |
| 银行存款 | 3,197,745.89 | - | 3,197,745.89 |
| 结算备付金 | 45,683.50 | - | 45,683.50 |
| 存出保证金 | 12,363.99 | - | 12,363.99 |
| 交易性金融资产 | - | 40,012,919.91 | 40,012,919.91 |
| 买入返售金融资产 | 6,000,000.00 | - | 6,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | 1,999,222.59 | 1,999,222.59 |
| 应收利息 | - | -1,365.72 | -1,365.72 |
| 其他资产 | - | - | - |
| 资产总计 | 9,255,793.38 | 42,010,776.78 | 51,266,570.16 |
| 负债 | | | |
| 应付管理人报酬 | - | 26,649.59 | 26,649.59 |
| 应付托管费 | - | 4,441.61 | 4,441.61 |
| 应付销售服务费 | - | 4,808.52 | 4,808.52 |
| 应付交易费用 | - | 7,997.82 | 7,997.82 |
| 其他负债 | - | 350,000.00 | 350,000.00 |
| 负债总计 | - | 393,897.54 | 393,897.54 |
| 利率敏感度缺口 | 9,255,793.38 | 41,616,879.24 | 50,872,672.62 |

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。

利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 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）<br>本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |
| | 市场利率下降25个基点 | - | - |
| | 市场利率上升25个基点 | - | - |

注：于2019年6月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2018年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018年12月31日：同）。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019-06-30 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 其它资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - |
| 应付托管费 | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | - | - | - |
| **项目** | **上期末<br>-** | | | |
| | **美元折合人民币** | **港币折合人民币** | **其他币种折合人民币** | **合计** |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | - | - | - |

注：不适用。

外汇风险的敏感性分析

| 假设 | - | | |
|---|---|---|---|
| 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）<br>本期末<br>2019-06-30 | 上年度末<br>2018-12-31 |

注：不适用。

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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在注重风险控制的基础上，将严谨的定性分析和规范的定量模型相结合，动态调整稳健资产和风险资产的配置比例；在此基础上精选债券和股票，以实现基金资产的稳健增值。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，来主动应对可能发生的市场价格风险。

开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%－95%；封闭期内，股票资产占基金资产的比例为0%－100%；开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019-06-30 | | 上年度末 2018-12-31 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产－股票投资 | 46,274,254.28 | 81.95 | 40,012,919.91 | 78.65 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 46,274,254.28 | 81.95 | 40,012,919.91 | 78.65 |

### 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 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 2019-06-30 | 上年度末 2018-12-31 |
| | 业绩比较基准上升5% | 4,912,243.46 | 4,621,273.58 |
| | 业绩比较基准下降5% | -4,912,243.46 | -4,621,273.58 |

### 采用风险价值法管理风险

不适用。

| 假设 | - | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 风险价值（金额单位：人民币元） | 本期末 2019-06-30 | 上年度末 2018-12-31 |

### 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为46,274,254.28元，无属于第二、三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日的经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 46,274,254.28 | 81.68 |
| | 其中：股票 | 46,274,254.28 | 81.68 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,353,045.75 | 18.27 |
| 8 | 其他各项资产 | 25,509.85 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 56,652,809.88 | 100.00 |

## 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 27,956.25 | 0.05 |
| C | 制造业 | 32,329,401.21 | 57.26 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 4,058,372.00 | 7.19 |
| 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 | 1,529,973.42 | 2.71 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 2,722,560.00 | 4.82 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,085,923.00 | 1.92 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 602.00 | 0.00 |
| 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 | 4,519,466.40 | 8.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 46,274,254.28 | 81.95 |

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 电信服务 | - | - |
| 非周期性消费品 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 信息科技 | - | - |
| 医疗 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 周期性消费品 | - | - |

注：本基金本报告期无港股通股票投资。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002701 | 奥瑞金 | 563,300 | 2,630,611.00 | 4.66 |
| 2 | 600809 | 山西汾酒 | 36,200 | 2,499,610.00 | 4.43 |
| 3 | 002462 | 嘉事堂 | 158,900 | 2,383,500.00 | 4.22 |
| 4 | 002029 | 七 匹 狼 | 358,261 | 2,314,366.06 | 4.10 |
| 5 | 002407 | 多氟多 | 195,086 | 2,309,818.24 | 4.09 |
| 6 | 002568 | 百润股份 | 128,900 | 2,304,732.00 | 4.08 |
| 7 | 300568 | 星源材质 | 86,000 | 1,982,300.00 | 3.51 |
| 8 | 600535 | 天士力 | 111,500 | 1,845,325.00 | 3.27 |
| 9 | 000400 | 许继电气 | 186,990 | 1,694,129.40 | 3.00 |
| 10 | 600266 | 北京城建 | 201,000 | 1,620,060.00 | 2.87 |
| 11 | 600037 | 歌华有线 | 147,334 | 1,510,173.50 | 2.67 |
| 12 | 600060 | 海信电器 | 137,040 | 1,181,284.80 | 2.09 |
| 13 | 600420 | 现代制药 | 128,600 | 1,147,112.00 | 2.03 |
| 14 | 000910 | 大亚圣象 | 102,500 | 1,141,850.00 | 2.02 |
| 15 | 002343 | 慈文传媒 | 148,440 | 1,122,206.40 | 1.99 |
| 16 | 601588 | 北辰实业 | 294,000 | 1,102,500.00 | 1.95 |
| 17 | 002707 | 众信旅游 | 178,900 | 1,085,923.00 | 1.92 |
| 18 | 600195 | 中牧股份 | 75,500 | 1,045,675.00 | 1.85 |
| 19 | 600859 | 王府井 | 68,800 | 1,045,072.00 | 1.85 |
| 20 | 300037 | 新宙邦 | 49,600 | 1,033,664.00 | 1.83 |
| 21 | 000892 | 欢瑞世纪 | 278,300 | 1,029,710.00 | 1.82 |
| 22 | 002454 | 松芝股份 | 185,100 | 960,669.00 | 1.70 |
| 23 | 603001 | 奥康国际 | 93,497 | 948,059.58 | 1.68 |
| 24 | 603556 | 海兴电力 | 66,450 | 918,339.00 | 1.63 |
| 25 | 300426 | 唐德影视 | 143,000 | 906,620.00 | 1.61 |
| 26 | 002108 | 沧州明珠 | 230,007 | 897,027.30 | 1.59 |
| 27 | 300129 | 泰胜风能 | 209,800 | 879,062.00 | 1.56 |
| 28 | 300403 | 汉宇集团 | 150,700 | 843,920.00 | 1.49 |
| 29 | 000823 | 超声电子 | 89,600 | 839,552.00 | 1.49 |
| 30 | 300251 | 光线传媒 | 123,400 | 839,120.00 | 1.49 |
| 31 | 600733 | 北汽蓝谷 | 100,800 | 832,608.00 | 1.47 |
| 32 | 600216 | 浙江医药 | 80,900 | 828,416.00 | 1.47 |
| 33 | 603111 | 康尼机电 | 136,000 | 670,480.00 | 1.19 |
| 34 | 600697 | 欧亚集团 | 33,500 | 629,800.00 | 1.12 |
| 35 | 300182 | 捷成股份 | 141,000 | 621,810.00 | 1.10 |
| 36 | 000625 | 长安汽车 | 81,800 | 542,334.00 | 0.96 |
| 37 | 600968 | 海油发展 | 7,875 | 27,956.25 | 0.05 |
| 38 | 601698 | 中国卫通 | 5,051 | 19,799.92 | 0.04 |
| 39 | 603915 | 国茂股份 | 841 | 19,570.07 | 0.03 |
| 40 | 603867 | 新化股份 | 696 | 17,963.76 | 0.03 |
| 41 | 600765 | 中航重机 | 100 | 923.00 | 0.00 |
| 42 | 000888 | 峨眉山A | 100 | 602.00 | 0.00 |

## 报告期内股票投资组合的重大变动

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 | 002407 | 多氟多 | 3,409,323.04 | 6.70 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 2,883,980.00 | 5.67 |
| 3 | 002462 | 嘉事堂 | 2,733,626.00 | 5.37 |
| 4 | 002701 | 奥瑞金 | 2,610,144.00 | 5.13 |
| 5 | 300568 | 星源材质 | 2,303,271.80 | 4.53 |
| 6 | 600809 | 山西汾酒 | 2,289,319.00 | 4.50 |
| 7 | 002108 | 沧州明珠 | 2,231,443.00 | 4.39 |
| 8 | 600535 | 天士力 | 2,065,516.00 | 4.06 |
| 9 | 000892 | 欢瑞世纪 | 1,712,533.00 | 3.37 |
| 10 | 000400 | 许继电气 | 1,703,653.00 | 3.35 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 1,596,813.00 | 3.14 |
| 12 | 002343 | 慈文传媒 | 1,590,457.00 | 3.13 |
| 13 | 600037 | 歌华有线 | 1,536,176.40 | 3.02 |
| 14 | 603556 | 海兴电力 | 1,456,849.50 | 2.86 |
| 15 | 002707 | 众信旅游 | 1,434,667.00 | 2.82 |
| 16 | 300037 | 新宙邦 | 1,323,285.00 | 2.60 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 1,283,680.00 | 2.52 |
| 18 | 600886 | 国投电力 | 1,246,518.00 | 2.45 |
| 19 | 600420 | 现代制药 | 1,199,712.00 | 2.36 |
| 20 | 000910 | 大亚圣象 | 1,183,401.00 | 2.33 |
| 21 | 300426 | 唐德影视 | 1,075,291.00 | 2.11 |

注：本项"买入金额"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。

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 | 600886 | 国投电力 | 3,450,666.32 | 6.78 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 2,838,574.00 | 5.58 |
| 3 | 000892 | 欢瑞世纪 | 2,578,908.83 | 5.07 |
| 4 | 000823 | 超声电子 | 2,275,650.72 | 4.47 |
| 5 | 601985 | 中国核电 | 2,242,534.00 | 4.41 |
| 6 | 601377 | 兴业证券 | 2,074,948.00 | 4.08 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 1,882,329.20 | 3.70 |
| 8 | 002241 | 歌尔股份 | 1,659,340.00 | 3.26 |
| 9 | 600809 | 山西汾酒 | 1,650,412.00 | 3.24 |
| 10 | 600096 | 云天化 | 1,637,604.22 | 3.22 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 1,596,813.00 | 3.14 |
| 12 | 600598 | 北大荒 | 1,496,038.67 | 2.94 |
| 13 | 600138 | 中青旅 | 1,493,375.00 | 2.94 |
| 14 | 600757 | 长江传媒 | 1,422,210.09 | 2.80 |
| 15 | 002074 | 国轩高科 | 1,411,126.60 | 2.77 |
| 16 | 000591 | 太阳能 | 1,299,430.00 | 2.55 |
| 17 | 600859 | 王府井 | 1,296,880.00 | 2.55 |
| 18 | 002108 | 沧州明珠 | 1,274,184.35 | 2.50 |
| 19 | 600718 | 东软集团 | 1,267,010.00 | 2.49 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 1,250,149.00 | 2.46 |
| 21 | 600037 | 歌华有线 | 1,139,133.00 | 2.24 |
| 22 | 600422 | 昆药集团 | 1,113,074.56 | 2.19 |
| 23 | 002385 | 大北农 | 1,083,479.80 | 2.13 |
| 24 | 000807 | 云铝股份 | 1,048,800.00 | 2.06 |
| 25 | 000802 | 北京文化 | 1,024,858.86 | 2.01 |

注：本项"卖出金额"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。

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 51,832,968.19 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 55,529,765.90 |

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

## 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注： 本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注： 本基金本报告期末未持有权证。

## 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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（买/卖） | 合约市值 | 公允价值变动 | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计 | | | | - | |
| 股指期货投资本期收益 | | | | - | |
| 股指期货投资本期公允价值变动 | | | | - | |

本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

## 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

## 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险指标说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | - | |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | - | |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | - | |

注：本基金报告期内未参与国债期货投资。

本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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 | 23,569.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,940.68 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,509.85 |

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

### 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。

## 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 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 |
| 中银证券瑞益混合A | 921 | 48,899.96 | 13,069,896.41 | 29.02 % | 31,966,971.05 | 70.98 % |
| 中银证券瑞益混合C | 206 | 31,107.89 | - | -% | 6,408,225.38 | 100.00 % |
| 合计 | 1,127 | 45,647.82 | 13,069,896.41 | 25.40 % | 38,375,196.43 | 74.60 % |

## 期末上市基金前十名持有人A

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|

## 期末上市基金前十名持有人B

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|

## 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|

## 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情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 中银证券瑞益混合A | 0 |
| | 中银证券瑞益混合C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中银证券瑞益混合A | 0 |
| | 中银证券瑞益混合C | 0 |
| | 合计 | 0 |

## 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | - | -% | - | -% | - |
| 基金管理人高级管理人员 | - | -% | - | -% | - |
| 基金经理等人员 | - | -% | - | -% | - |
| 基金管理人股东 | - | -% | - | -% | - |
| 其他 | - | -% | - | -% | - |
| 合计 | - | -% | - | -% | - |

## 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 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

中银国际证券股份有限公司董事会秘书翟增军先生担任公司公募基金管理业务副总经理，熊文龙先生不再担任公司副执行总裁。
托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

## 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

## 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内基金管理人没有改聘会计师事务所。

## 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

未有管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 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 | | 基金交易 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券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 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中银证券 | 2 | 106,769,108.36 | 100.00 % | - | -% | - | -% | 484,300,000.00 | 100.00 % | - | -% | 78,079.46 | 100.00 % | - |

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。
2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：
(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：
(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。 1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。
2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：
(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：
(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

## 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 | 中银国际证券股份有限公司旗下基金2018年12月31日基金净值（收益）公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司官网 | 2019-01-02 |
| 2 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金2018年第4季度报告 | 上海证券报、公司官网 | 2019-01-22 |
| 3 | 中银国际证券股份有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》公司官网 | 2019-02-19 |
| 4 | 中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》公司官网 | 2019-03-07 |
| 5 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第1号） | 上海证券报、公司官网 | 2019-03-11 |
| 6 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2019年第1号） | 公司官网 | 2019-03-11 |
| 7 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金2018年年度报告 | 公司官网 | 2019-03-28 |
| 8 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金2018年年度报告摘要 | 上海证券报、公司官网 | 2019-03-28 |
| 9 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金第四个开放期开放申购、赎回业务的公告 | 上海证券报、公司官网 | 2019-04-04 |
| 10 | 中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告 | 上海证券报、公司官网 | 2019-04-18 |
| 11 | 中银国际证券股份有限公司关于旗下基金开通基金转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》公司官网 | 2019-04-26 |
| 12 | 中银国际证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》公司官网 | 2019-05-16 |

注：全部公告均在公司网站披露,部分公告在公司网站及报纸披露。

## 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| - | | | | | | | |

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未有达到或超过20%的情况。

## 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 备查文件目录

1、中国证监会准予中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
2、《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3、《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4、法律意见书
5、基金管理人的业务资格批件、营业执照
6、基金托管人的业务资格批件、营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

## 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人基金网站www.bocifunds.com。

## 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人基金网站www.bocifunds.com查阅。