国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金(原国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金转型)2018 年半年度报告摘要

(上接 B436 版)

7.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 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	300369	绿盟科技	22,417,057.72	2.59
2	600731	湖南海利	19,283,097.99	2.22

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。

7.2.4.2 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	300369	绿盟科技	25,817,470.51	2.98
2	600731	湖南海利	19,117,002.36	2.20
3	002665	首航节能	7,681,408.08	0.89
4	300580	贝斯特	1,741.73	0.00

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

7.2.4.3 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

买入股票的成本(成交)总额	41,700,155.71
卖出股票的收入(成交)总额	52,617,622.68

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。

7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.8 报告期末按公允价值占基金贵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。

7.2.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险,本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,适度运用国债期货,提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时,本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系,选择定价合理的国债期货合约,其次,考虑国债期货各合约的流动性情况,最终确定与现货组合的合适匹配,以达到风险管理的目标。

7.2.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

7.2.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

7.2.12.3 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	49,418.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	174,854.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,272.68

7.2.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.2.12.6 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 国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 3 月 9 日-2018 年 6 月 30 日)

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,153	61,347.57	-	-	70,733,753.64	100.00%

8.1.2 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	99.14	0.00%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

8.2 国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 1 日-2018 年 3 月 8 日)

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,923	90,980.79	-	-	174,956,065.94	100.00%

8.2.2 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	99.14	0.00%

8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

9 开放式基金份额变动

9.1 国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 3 月 9 日-2018 年 6 月 30 日)

单位:份

基金合同生效日(2018 年 3 月 9 日)基金份额总额	174,956,065.94
本报告期期初基金份额总额	174,956,065.94
本报告期基金总申购份额	148,746.34
减:本报告期基金总赎回份额	104,371,058.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	70,733,753.64

注:本基金由国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金转型而来并于 2018 年 3 月 9 日合同生效。

9.2 国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 1 日-2018 年 3 月 8 日)

单位:份

基金合同生效日(2016 年 3 月 2 日)基金份额总额	1,931,707,961.50
本报告期期初基金份额总额	835,196,550.40
本报告期基金总申购份额	49,272.85
减:本报告期基金总赎回份额	660,289,757.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	174,956,065.94

注:根据《国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,2018 年 3 月 2 日为国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金保本周期到期日。本基金保本周期到期时,根据国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金基金合同的约定转型为国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金。在国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金的到期期间内,即 2018 年 3 月 2 日至 2018 年 3 月 8 日基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自 2018 年 3 月 9 日,国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金转型为国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金。

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、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

国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金基金合同于 2018 年 3 月 9 日起转型为非保本的国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金,自转型之日起,基金的投资目标、投资范围、投资策略已依据《基金合同》的相关约定作相应修改。转型后基金的风险收益特征相应转变,基金管理人已于 2018 年 2 月 9 日发布《关于国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金启相关业务规则的公告》,并于 2018 年 2 月 23 日发布《国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金保本周期到期转型的提示性公告》,对上述事项进行提示。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

10.6 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 3 月 9 日-2018 年 6 月 30 日)

10.8.1.1 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
方正证券	1	11,024,105.87	11.58%	10,266.69	11.58%
华创证券	1	9,421,821.40	9.89%	8,774.45	9.89%
中银万国	1	8,906,515.96	9.35%	8,294.89	9.35%
海通证券	2	8,723,202.40	9.16%	8,123.93	9.16%
东北证券	1	8,722,659.55	9.16%	8,123.42	9.16%
安信证券	3	7,923,986.80	8.32%	7,379.56	8.32%
兴业证券	1	6,275,186.00	6.59%	5,844.00	6.59%
瑞银证券	2	6,048,407.00	6.35%	5,632.93	6.35%
东吴证券	1	5,396,077.45	5.67%	5,025.18	5.67%
长江证券	1	5,214,678.00	5.48%	4,856.59	5.48%
中信证券	2	4,734,705.96	4.97%	4,409.52	4.97%
广发证券	1	4,065,936.00	4.27%	3,786.69	4.27%
广州证券	2	3,551,761.30	3.73%	3,307.77	3.73%
国金证券	1	2,279,052.00	2.39%	2,122.49	2.39%
华泰证券	2	1,211,995.41	1.27%	1,128.83	1.27%
东方证券	1	1,003,955.00	1.05%	934.99	1.05%
民生证券	1	732,052.00	0.77%	681.76	0.77%

10.8.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	8,600,000.00	12.76%	-	-
安信证券	808,000.00	0.95%	-	-	-	-
兴业证券	10,091,841.29	11.86%	-	-	-	-
瑞银证券	399,412.10	0.47%	8,000,000.00	11.87%	-	-
东吴证券	3,005,720.00	3.53%	8,400,000.00	12.46%	-	-
长江证券	48,847,052.12	57.43%	-	-	-	-
中信证券	9,876,000.00	11.61%	-	-	-	-
华泰证券	2,061,231.71	2.42%	42,400,000.00	62.91%	-	-
国元证券	9,972,000.00	11.72%	-	-	-	-

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、本报告期末基金租用中信证券 1 个交易单元。

4、上述数据为国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 8 日租用证券公司交易单元发生交易量和应付券商佣金金额。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

11.1.1 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

产品特有风险
投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时,可能出现以下风险: 1.赎回申请延期办理的风险 单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。 2.基金净值大幅波动的风险 单一投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;单一投资者大额赎回时,相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。 3.基金投资策略难以实现的风险 单一投资者大额赎回后,可能使基金资产净值显著降低,从而使基金在拟参与银行同市场交易等投资时受到限制,导致基金投资策略难以实现。 4.基金财产清盘(或转型)的风险 根据本基金基金合同的约定,基金合同生效后的存续期内,若连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。单一投资者大额赎回后,可能造成基金资产净值大幅缩减而导致本基金转换运作方式、与其他基金合并或基金合同终止等情形。 5.召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险 由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高,在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时,单一机构投资者将拥有高的投票权重。

注:本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 国投瑞银瑞祥保本混合型证券投资基金

11.2.1 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	1	20180101-20180304	200,072,888.88	0.00	200,072,888.88	0.00	0.00%

产品特有风险
投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时,可能出现以下风险: 1.赎回申请延期办理的风险 单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。 2.基金净值大幅波动的风险 单一投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;单一投资者大额赎回时,相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。 3.基金投资策略难以实现的风险 单一投资者大额赎回后,可能使基金资产净值显著降低,从而使基金在拟参与银行同市场交易等投资时受到限制,导致基金投资策略难以实现。 4.基金财产清盘(或转型)的风险 根据本基金基金合同的约定,基金合同生效后的存续期内,若连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。单一投资者大额赎回后,可能造成基金资产净值大幅缩减而导致本基金转换运作方式、与其他基金合并或基金合同终止等情形。 5.召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险 由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高,在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时,单一机构投资者将拥有高的投票权重。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日

国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金(原国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金转型)2018年半年度报告摘要

(上接 B437 版)

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	113013	国君转债	1,037,414.40	3.02
2	113009	广汽转债	974,069.00	2.83

7.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.1.12.6 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。

7.2 国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 1 日-2018 年 1 月 5 日)

7.2.1 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	2,778,372.00	2.58
	其中:股票	2,778,372.00	2.58
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	104,792,367.12	97.23
8	其他各项资产	211,356.53	0.20
9	合计	107,782,095.65	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	2,778,372.00	2.83
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
T	合计	2,778,372.00	2.83

7.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2.3 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	300580	贝斯特	127,800.00	2,778,372.00	2.83

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 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	300580	贝斯特	2,778,372.00	2.83

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。

7.2.4.2 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	300369	绿盟科技	25,817,470.51	2.98
2	600731	湖南海利	19,117,002.36	2.20
3	002665	首航节能	7,681,408.08	0.89
4	300580	贝斯特	1,741.73	0.00

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

7.2.4.3 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

买入股票的成本(成交)总额	1,793,810.80
卖出股票的收入(成交)总额	143,286,977.66

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。

7.2.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,000,000.00	2.59
	其中:政策性金融债	30,000,000.00	2.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	30,000,000.00	2.59

7.2.6 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

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	170203	17国开03	300,000	30,000,000.00	2.59

注:本基金本报告期末仅持有以上债券投资。

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.8 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。

7.2.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险,本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,适度运用国债期货,提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时,本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系,选择定价合理的国债期货合约,其次,考虑国债期货各合约的流动性情况,最终确定与现货组合的合适匹配,以达到风险管理的目标。

7.2.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

7.2.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

7.2.12.3 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	184,406.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,004,616.21
5	应收申购款	4,571.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,193,594.61

7.2.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	3,338,192.00	0.29	重大事项停牌
2	601838	成都银行	89,465.01	0.01	新股未上市

7.2.12.6 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 国投瑞银瑞源灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 23 日-2018 年 6 月 30 日)

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,011	35,822.20	0.00	0.00%	36,216,244.01	100.00%

8.1.2 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	581,466.28	1.61%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

8.2 国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 1 日-2018 年 1 月 5 日)

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,246	76,041.22	0.00	0.00%	94,747,359.77	100.00%

8.2.2 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	51,013.63	0.05%

8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

9 开放式基金份额变动

9.1 国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 6 日-2018 年 6 月 30 日)

单位:份

基金合同生效日(2018 年 1 月 6 日)基金份额总额	94,747,359.77
本报告期期初基金份额总额	94,747,359.77
本报告期基金总申购份额	13,666,811.16
减:本报告期基金总赎回份额	72,197,926.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,216,244.01

注:本基金由国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金转型而来并于 2018 年 1 月 6 日合同生效。

9.2 国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 1 日-2018 年 1 月 5 日)

单位:份

基金合同生效日(2015 年 12 月 29 日)基金份额总额	1,998,023,466.34
本报告期期初基金份额总额	997,598,377.16
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	902,851,017.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	94,747,359.77

注:根据《国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,2017 年 12 月 29 日为国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金的保本周期到期日。在本基金的到期期间内,即 2017 年 12 月 29 日至 2018 年 1 月 5 日本基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自 2018 年 1 月 6 日,国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金转型为国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金,因此上表报告期间的结束日为 2018 年 1 月 5 日。

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、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

根据国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金基金合同的约定,保本周期到期后,因未能符合保本基金存续条件,自 2018 年 1 月 6 日起,"国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金"转型为非保本的"国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金",基金投资策略由"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。CPPI 和 TIPP 是国际通行的投资组合保险策略,主要是通过数量分析,根据市场的波动来调整、修正收益资产的风险乘数,以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值,从而达到对投资组合保值增值的目的。投资过程中,基金管理人需在股票投资风险加大和收益增强这两者之间寻找适当的平衡点,即确定适当的风险乘数,力求既能够保证投资组合本金的安全,又能尽量为投资者创造更多收益。"变更为"本混合型基金充分发挥管理人的研究优势,将严谨、规范化选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济周期市场环境变化趋势的基础上,动态调整投资组合比例,自而下灵活配置产;通过把握和判断行业发展趋势及行景气程度变化,挖掘预期具有良好增长前景的优势行业,精选个股,以谋求超额收益。"

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期内未持有基金。

10.6 报告期内改聘会计师事务所情况

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

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018 年 1 月 23 日-2018 年 6 月 30 日)

10.8.1.1 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
民生证券	1	19,117,002.36	20.27%	17,803.34	20.27%
广发证券	1	18,099,895.80	19.19%	16,856.38	19.19%
海通证券	2	16,769,979.71	17.78%	15,617.93	17.78%
兴业证券	1	12,283,966.16	13.02%	11,440.20	13.02%
国金证券	1	11,998,570.00	12.72%	11,174.17	12.72%
安信证券	3	7,006,140.00	7.43%	6,524.89	7.43%
中信建投证券	3	6,999,131.83	7.42%	6,518.16	7.42%
国信证券	1	2,043,092.53	2.17%	1,902.74	2.17%

10.8.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	6,245,598.19	8.03%	-	-	-	-
海通证券	9,004,819.17	11.57%	-	-	-	-
兴业证券	4,541,833.50	5.84%	-	-	-	-
安信证券	417,616.34	0.54%	-	-	-	-
国信证券	42,392,285.76	54.48%	-	-	-	-
中信证券	1,976,813.90	2.54%	-	-	-	-
长江证券	4,762,279.46	6.12%	-	-	-	-
华创证券	8,467,146.60	10.88%	-	-	-	-

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回购及权证交易。

3、本报告期末基金租用中信证券 1 个交易单元。

4、上述数据为国投瑞银瑞