国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	国投瑞银双债丰利定开债券	
基金主代码	161230	
基金运作方式	契约型,以定期开放方式运作	
基金合同生效日	2016年2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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	202,086,117.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银双债丰利定开债A	国投瑞银双债丰利定开债C
下属分级基金场内简称	丰利A类	-
下属分级基金的交易代码	161230	161231
报告期末下属分级基金的份额总额	201,405,670.27份	680,447.64份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	1.资产配置 本基金采取稳健灵活的投资策略,主要通过对可转债、信用债等固定收益类金融工具的主动管理,力求在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值;并根据对权益类市场的趋势研判适度参与权益类资产投资,力求提高基金总体收益率。 2.债券投资管理 本基金采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。 同时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。 3.股票投资策略 基金管理人将把握权益类资产出现的趋势性或结构性投资机会,在本基金合同约定范围内直接投资权益类资产,努力获取超额收益。
业绩比较基准	中证可转债指数×40%+中证信用债指数×60%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	田青
	联系电话	400-880-6868	010-67595096
	电子邮箱	service@ubssdtic.com	tianqing12h@ccb.com
客户服务电话		400-880-6868	010-67595096
传真		0755-82904048	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)	
	国投瑞银双债丰利定开债A	国投瑞银双债丰利定开债C
本期已实现收益	-18,778,722.05	-33,531.28
本期利润	-5,366,716.07	-11,115.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0161	-0.0133
本期基金份额净值增长率	-0.27%	-0.53%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	国投瑞银双债丰利定开债A	国投瑞银双债丰利定开债C
期末可供分配基金份额利润	-0.0064	-0.0089
期末基金资产净值	200,107,345.87	674,364.53
期末基金份额净值	0.994	0.991

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

国投瑞银双债丰利定开债A

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	-0.30%	0.15%	-1.08%	0.32%	0.78%	-0.17%
过去三个月	-1.58%	0.15%	-1.71%	0.27%	0.13%	-0.12%
过去六个月	-0.27%	0.22%	0.99%	0.31%	-1.26%	-0.09%
过去一年	1.69%	0.20%	-0.01%	0.27%	1.70%	-0.07%
自基金合同生效起至今	7.44%	0.16%	1.19%	0.24%	6.25%	-0.08%

国投瑞银双债丰利定开债C

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%	0.14%	-1.08%	0.32%	0.68%	-0.18%
过去三个月	-1.68%	0.14%	-1.71%	0.27%	0.03%	-0.13%
过去六个月	-0.53%	0.22%	0.99%	0.31%	-1.52%	-0.09%
过去一年	1.27%	0.20%	-0.01%	0.27%	1.28%	-0.07%
自基金合同生效起至今	6.36%	0.16%	1.19%	0.24%	5.17%	-0.08%

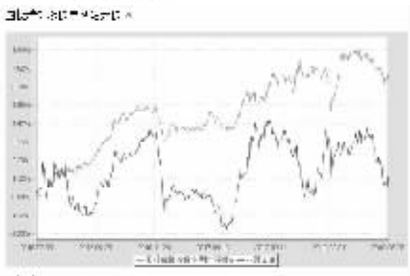
注:1、本基金以可转债、信用债为主要投资方向,强调基金资产的稳定增值;本基金以中证可转债指数、中证信用债指数为基础构建业绩比较基准,主要是鉴于上述指数的公允性和权威性,以及上述指数与本基金投资策略的一致性。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

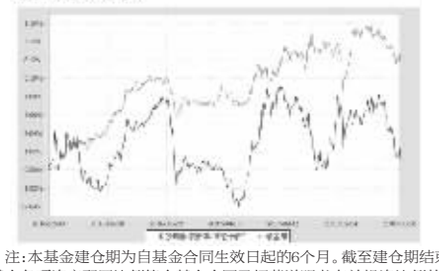
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金
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
(2016年2月3日至2018年6月30日)

国投瑞银双债丰利定开债A



国投瑞银双债丰利定开债C



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司(简称“公司”),原中融基金管理有限公司,经中国证券监督管理委员会批准,于2002年6月13日成立,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2018年6月底,在公募基金方面,公司共管理73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信托计划提供投资咨询服务,具有丰富经验,并于2007年获得QDII资格。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘莎莎	本基金基金经理	2016-02-03	-	10	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任中诚信证券评估公司分析师、阳光保险资产管理中心信用研究员、泰康资产管理有限公司信用研究员。2013年7月加入国投瑞银。曾任国投瑞银双债增利债券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。现任国投瑞银岁增利一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银岁属利一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银中高等级债券型证券投资基金和国投瑞银兴顺多策略混合型证券投资基金基金经理。
桑俊	本基金基金经理,研究部副总经理	2016-08-06	-	10	中国籍,博士,具有基金从业资格。曾任惠裕证券研究所,2012年5月加入国投瑞银。曾任国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。现任国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新动力灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银精选收益灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银锐化选收益灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新活长灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银成长优选混合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《国投瑞银双债丰利两年定期开放债券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

2018年上半年债券市场走出分化行情。信用债净融资额明显下行。6月份信用债发行总量3869亿元,同比增加191亿元,净融资额445亿元。从期限结构看,中票发行失败的比例显著高于短融。一级发行分化加剧,AAA过剩龙头短券需求旺盛,低估值价格发行的现象较普遍,AA城投和民企需求冷淡,打开上限后未募满的情况增多。整个市场呈现出利率债及高等级信用债收到追捧,低等级信用债交易清淡,收益率持续走高的现象。

从等级利差来看,中低等级利差已经处于历史很高分位水平,其主要原因还是因为再融资困难下,债市总体降低风险偏好,需求集中在高等级以及流动性好的资产。中低等级利差压缩的机会,仍需密切关注政策因素。在坚决去杠杆的环境下,可能等级利差仍将保持高位。趋势性机会取决于在经济下行压力展现后,融资政策的转向,仍需等待并持续关注政策动向。上半年操作上,债券主要为信用债中短久期票息策略为主,利率小仓位参与。股票仓位维持谨慎,在贸易战持续发酵,国内融资环境偏紧的整体环境下,维持绝对收益目标,偏重有真实业绩的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金A级份额净值为0.994元,C级份额净值为0.991元,本报告期末A级份额净值增长率为-0.27%,C级份额净值增长率为-0.53%,同期业绩比较基准收益率为0.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,三季度经济下行压力仍在,债券市场整体偏利好,积极的财政政策初期有利于缓解市场对中低等级信用风险的担忧,城投等与基建相关的信用债利差有望压缩。但民企信用债可能仍存在一定再融资压力。四季度需关注政策调整后基本面走势对债市的影响。

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估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果,最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后,应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商,必要时征求会计师事务所的专业意见,并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员;估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议,并按照有关议事规则讨论审议,决定批准或不批准使用特殊估值调整;运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序,准备特殊估值调整事项的临时公告,并发起信息披露审批流程;监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末,本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司建立业务合作关系,由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

国投瑞银双债丰利A级份额本期已实现收益为-18,778,722.05 元,期末可供分配利润为-1,298,324.40元;报告期内本基金共实施2次收益分配,累计分配5,141,824.63元,每10份基金份额分红0.124元。

国投瑞银双债丰利C级份额本期已实现收益为-33,531.28元,期末可供分配利润为-6,083.11 元。报告期内本基金共实施2次收益分配,累计分配10,669.31元,每10份基金份额分红0.118元。

报告期本基金的利润分配符合法律法规的相关规定和《基金合同》的约定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内本基金共实施2次收益分配,实施利润分配的金额为5,152,493.94元,国投瑞银双债丰利A级份额累计分配5,141,824.63元,国投瑞银双债丰利C级份额累计分配10,669.31元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	5,506,594.71	4,071,203.41
结算备付金	367,378.44	3,029,328.74
存出保证金	142,565.37	134,477.49
交易性金融资产	191,057,737.28	788,434,819.17
其中:股票投资	9,120,425.08	89,353,943.67
基金投资	-	-
债券投资	181,937,312.20	699,080,875.50
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	-	-
应收证券清算款	-	7,926,461.99
应收利息	4,099,170.83	14,767,744.84
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	201,173,406.63	818,364,035.64
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	6,076,347.72
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	99,114.26	412,439.53
应付托管费	33,038.11	137,479.85
应付销售服务费	222.00	469.92
应付交易费用	73,305.52	590,241.94
应交税费	24,853.94	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	161,162.40	255,000.00
负债合计	391,696.23	7,471,978.96
所有者权益:	-	-
实收基金	202,086,117.91	803,780,019.03
未分配利润	-1,304,407.51	7,112,037.65
所有者权益合计	200,781,710.40	810,892,056.68
负债和所有者权益总计	201,173,406.63	818,364,035.64

注:国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金(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”)证监基金字[2014]99号文《关于核准国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金设立的批复》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2016年2月3日正式生效,首次设立募集规模为803,780,019.03份基金份额。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(2016)第141号验资报告予以验证。本基金为契约型,以定期开放方式运作,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,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”),中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)担任注册登记机构。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的可转债(含可分离交易可转债)、信用债(金融债、企业债、公司债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债、中小企业私募债券等非国家信用的固定收益类金融工具)、国债、央行票据、债券回购、银行存款、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、权证、国债期货等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。

本基金投资于债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中,可转债、信用债合计投资比例不低于债券资产的80%;本基金投资于权益类资产的比例不超过基金资产的20%;但在每个开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在运作周期内在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于交易保证金一倍的现金;在开放期内每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金转型后,投资范围根据本基金合同第二十章相关约定进行调整。

本基金的业绩比较基准为“中证可转债指数×40%+中证信用债指数×60%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年半年度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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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重大会计差错和更正。

6.4.5.3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。

6.4.6 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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改(征收教育费附加的暂行规定)的决定》其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 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。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。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。金融商品转让,按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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。存款利息收入不征收增值税。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。根据上海市虹口区税务局规定,地方教育费附加的税率于2018年7月1日起由之前的2%调整为1%。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
安信证券股份有限公司(“安信证券”)	与基金管理人受同一实际控制的公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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
安信证券	31,455,319.53	5.69%	4,038,913.45	1.47%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	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
安信证券	29,294.43	5.69%	7,326.89	10.02%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	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
安信证券	3,761.44	1.47%	-	-

注:1、上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定,并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示,其中债券、回购及权证交易不计佣金。

2、该类席位租用协议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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	975,402.47	2,398,427.12
其中:支付销售机构的客户维护费	1,149.24	1,871.08

注:支付基金管理人国投瑞银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	325,134.18	799,475.67

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银双债丰利定开债A	国投瑞银双债丰利定开债C	合计
国投瑞银基金管理有限公司	-	265.60	265.60
中国建设银行	-	-	-
合计	-	265.60	265.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银双债丰利定开债A	国投瑞银双债丰利定开债C	合计
中国建设银行	-	-	-
国投瑞银基金管理有限公司	-	637.89	637.89
合计	-	637.89	637.89

注:本基金C类基金份额收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.40 %/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国建设银行股份有限公司	5,506,554.71	81,067.53	12,698,081.14	65,885.08

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1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
300367	东方网力	2016-1-18	2018-1-21	非公开发行	24.50	11.66	408,163.00	9,999,993.50	4,759,180.58	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,120,425.08	4.53
	其中:股票	9,120,425.08	4.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	181,937,312.20	90.44
	其中:债券	181,937,312.20	90.44
	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	5,873,933.15	2.92
8	其他各项资产	4,241,736.20	2.11
9	合计	201,173,406.63	100.00

注: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 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	9,120,425.08	4.54
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	-	-
	合计	9,120,425.08	4.54

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300367	东方网力	409,026.00	4,769,968.08	2.38
2	603799	华友钴业	30,100.00	2,933,847.00	1.46
3	600884	杉杉股份	64,100.00	1,416,610.00	0.71

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

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	25,927,855.00	3.20
2	601288	农业银行	24,157,618.00	2.98
3	601899	紫金矿业	16,235,815.00	2.00
4	601318	中国平安	16,155,827.00	1.99
5	601601	中国太保	16,140,351.30	1.99
6	601009	南京银行	12,103,507.00	1.49
7	600030	中信证券	12,065,694.00	1.49
8	600197	伊力特	8,082,593.00	1.00
9	600702	舍得酒业	8,047,548.00	0.99
10	002258	利尔化学	8,026,136.00	0.99
11	603799	华友