中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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
送出日期:2018年8月28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。

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27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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券瑞益混合	
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年1月25日	
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	50,173,193.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中银证券瑞益混合A	中银证券瑞益混合C
下属分级基金的交易代码:	003980	003981
报告期末下属分级基金的份额总额	45,360,238.33份	4,812,954.97份

2.2 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。

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		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

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§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

基金级别	中银证券瑞益混合A	中银证券瑞益混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日- 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-3,324,440.02	34,567.64
本期利润	6,858,053.28	-91,065.00
加权平均基金份额本期利润	0.0417	-0.0192
本期基金份额净值增长率	-1.41%	-1.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0345	0.0266
期末基金资产净值	46,924,371.64	4,940,862.57
期末基金份额净值	1.0345	1.0266

注:1、本基金合同于2017年1月25日生效。

2、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。

3、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。

4、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。

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

中银证券瑞益混合A

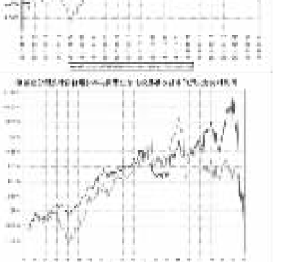
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.45%	1.07%	-2.90%	0.51%	-4.55%	0.56%
过去三个月	-4.99%	0.76%	-3.43%	0.45%	-1.56%	0.31%
过去六个月	-1.41%	0.59%	-3.96%	0.46%	2.55%	0.13%
过去一年	-0.08%	0.43%	-0.96%	0.38%	0.88%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.45%	0.37%	1.47%	0.34%	1.98%	0.03%

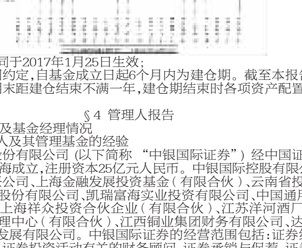
中银证券瑞益混合C

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	-7.49%	1.07%	-2.90%	0.51%	-4.59%	0.56%
过去三个月	-5.10%	0.76%	-3.43%	0.45%	-1.67%	0.31%
过去六个月	-1.70%	0.59%	-3.96%	0.46%	2.26%	0.13%
过去一年	-0.63%	0.43%	-0.96%	0.38%	0.33%	0.05%
自基金合同生效起至今	2.66%	0.37%	1.47%	0.34%	1.19%	0.03%

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%。

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





注:1、本基金合同于2017年1月25日生效;

2、按照基金合同约定,自基金成立日起6个月内为建仓期。截至本报告期末,基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年,建仓期结束时各项资产配置比例是符合合同约定。

§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

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。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。截至2018年6月30日,本管理人共管理14只证券投资基金,包括: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成立于2018年8月2日。

4.1.2 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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴亮谷	本基金基金经理	2017年1月25日	-	9	吴亮谷,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。历任福建海峡银行债券交易员、平安银行债券交易员、投资经理,天治基金管理有限公司天治天得利货币市场基金基金经理、天治稳定收益证券投资基金基金经理。2014年加盟中银国际证券股份有限公司,历任中银国际证券中国红债券宝投资主办人、中银证券保本1号混合型证券投资基金基金经理,现任中银国际证券中国红货币宝投资主办人、中银证券安进债券型证券投资基金、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基金经理。
罗众球	本基金基金经理	2017年1月25日	-	7	罗众球,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。2009年至2010年任职于复星医药药品研发部;2010年至2012年任职于恒泰证券,担任医药行业研究员;2012年至2013年8月任职于东海证券资产管理分公司,担任医药行业研究员。2013年8月加盟中银国际证券股份有限公司,现任中国红稳定价值、中国红稳健增长、中国红1号集合资产管理计划投资主办人、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券保本1号混合型证券投资基金、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、中银证券瑞丰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基金经理。
王玉玺	本基金基金经理	2017年1月26日	-	12	王玉玺,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。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,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、中银证券保本1号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基金经理。
张燕	本基金基金经理	2018年1月19日	-	6	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,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、中银证券健康产业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。

4.2 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。

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

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、产品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。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,主要包括授权、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环节。研究团队负责提供投资研究支持,投资团队负责投资决策,交易室负责实施交易并实时监控,风险管理部负责事前监督、事中检查和事后稽核,对交易情况进行合理性分析。通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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,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。

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年以来,市场干扰因素多,波动较大。年初海外美股的快速回调引发市场对于全球经济危机的担忧,后续资管新规、股权质押去杠杆等政策持续冲击。春节后开工不达预期加重了对经济启动的担忧,周期承压。二月中旬,随着监管层支持新经济、支持独角兽企业快速上市等政策暖风频吹,市场风格急剧转换,前期深度回调的创业板开始领涨。三月下旬中美贸易摩擦又平添了变数,后续在二季度持续升级和发酵。六月份棚改政策的调整使脆弱的市场再次雪上加霜。

市场表现看,年初蓝筹股大幅上扬而创业板继续走弱,二月初市场大跌后风格发生明显转换,大盘蓝筹持续大幅回调而成长股涨幅较大,跷跷板型分化行情继续。上证50、沪深300、中小板指及创业板指在一月份涨幅分别为8.96%、6.08%、-1.78%、-1%,二月份涨幅分别为-7.64%、-5.9%、0.76%、1.07%,三月份涨幅分别为-5.44%、-3.11%、-0.45%、8.37%。进入二季度,市场基本进入普跌通道,除防御性的医药、食品饮料、休闲服务等板块有上涨外,其他板块持续下跌。

今年以来,在市场波动加剧持续调整的市场环境下,本基金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,重点配置了估值较低同时行业景气反转有望戴维斯双击的消费子行业。低估值消费板块是配置的主体,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。

4.4.2 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1.0345元,本报告期基金份额净值增长率为-1.41%;截至本报告期末中银证券瑞益混合C基金份额净值为1.0266元,本报告期基金份额净值增长率为-1.70%;同期业绩比较基准收益率为-3.96%。

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,一方面,积极财政政策或将更加积极,货币政策或将维持继续维持宽松,信用收紧的程度或将有所改善,基建投资或将触底回升。但另一方面,地方政府融资平台和部分国有企业仍有较大债务压力,去杠杆大方向仍然坚定;房地产开发投资力度在严格调控政策下或将有所减缓,加之中美贸易摩擦的不确定性,经济下行压力或将仍存。总体来看,在政府一系列前瞻性稳经济政策的支持下,经济下行动力或将有所放缓,但难改下行趋势。综上,预计下半年利率债和中高等级信用债或将仍有较好表现,但下行空间或有限;中高等级信用债和低等级信用债之间利差仍或将继续保持分化。

权益市场方面,伴随着市场的持续调整,各方面风险暴露愈加充分,越来越多的个股中长期投资价值凸显,中期看市场或有较好的表现。

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有限责任公司估值委员会(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,成员由基金事业部、业务营运部、内控与法律合规部、稽核部、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。

4.7 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。

4.8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。

§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,本基金未实施利润分配。

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: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:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	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		3,681,508.80	282,682.24
结算备付金		1,914,714.20	679,753.82
存出保证金		55,606.16	18,503.20
交易性金融资产		36,662,028.06	558,686,955.33
其中:股票投资		34,670,028.06	126,554,667.93
基金投资		-	-
债券投资		1,992,000.00	432,132,287.40
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		10,000,000.00	-
应收证券清算款		61,524.63	-
应收利息		59,041.56	6,982,841.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	29.80
资产总计		52,434,423.41	566,650,766.38
负债和所有者权益	附注号	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		-	121,277,450.03
应付证券清算款		251,391.22	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,510.25	226,380.50
应付托管费		4,418.37	37,730.08
应付销售服务费		2,104.94	65,730.40
应付交易费用		3,523.58	39,620.30
应交税费		234.53	-
应付利息		-	88,765.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		281,006.31	365,010.00
负债合计		569,189.20	122,100,686.79
所有者权益:			
实收基金		50,173,193.30	423,681,910.54
未分配利润		1,692,040.91	20,868,169.05
所有者权益合计		51,865,234.21	444,550,079.59
负债和所有者权益总计		52,434,423.41	566,650,766.38

注:报告截止日2018年6月30日,中银证券瑞益混合A基金份额净值1.0345元,基金份额总额45360238.33份;中银证券瑞益混合C基金份额净值1.0266元,基金份额总额4812954.97份。中银证券瑞益混合份额总额合计为50173193.30份。

6.2 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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入		8,458,550.63	25,562,260.79
1.利息收入		4,059,887.35	9,512,019.34
其中:存款利息收入		42,570.57	211,645.77
债券利息收入		3,344,150.79	5,315,921.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		673,165.99	3,984,452.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-5,658,197.38	16,731,062.48
其中:股票投资收益		-5,586,910.30	16,197,543.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-352,880.86	-807,374.03
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		281,593.78	1,340,893.30
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		10,056,860.66	-719,923.72
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	39,102.69
减:二、费用		1,691,562.35	3,157,702.46
1. 管理人报酬		557,512.92	1,651,835.34
2. 托管费		92,918.82	275,305.92
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	12,549.42	46,607.83
4. 交易费用		296,792.14	525,121.59
5. 利息支出		521,962.49	473,759.98
其中:卖出回购金融资产支出		521,962.49	473,759.98
6. 其他费用		204,093.67	185,071.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,766,988.28	22,404,558.33
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,766,988.28	22,404,558.33

6.3 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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	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
项目	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017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)	635,243,530.39	-	635,243,530.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	22,404,558.33	22,404,558.33
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)	635,243,530.39	22,404,558.33	657,648,088.72

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:

______宁敏______ ______赵向雷______ ____戴景义____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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2018年8月28日批准报出。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券保本1号混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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。

6.4.4 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。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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》、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。

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

注:无。

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
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(“中国建设银行”)	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

6.4.8 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。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
中银证券	184,356,798.60	100.00%	437,309,475.74	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
中银证券	85,209,075.77	100.00%	27,735,929.60	100.00%

6.4.8.1.3 债券回购交易

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 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中银证券	1,186,296,000.00	100.00%	6,003,600,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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
中银证券	134,810.55	100.00%	2,447.59	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)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
中银证券	319,803.12	100.00%	83,997.68	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。

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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	557,512.92	1,651,835.34
其中:支付销售机构的客户维护费	37,521.84	185,383.31

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。

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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	92,918.82	275,305.92

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

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 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
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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日 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
中银证券	-	37,247.65	37,247.65
中国银行	-	9,360.18	9,360.18
合计	-	46,607.83	46,607.83

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

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

注:本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)的交易。

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

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 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年1月25日)持有的基金份额	19,999,000.00	-
期初持有的基金份额	19,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	19,999,000.00	-
期末持有的基金份额	0.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-
项目	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日 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年1月25日)持有的基金份额	19,999,000.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.7200%	-

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

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。

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 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
建设银行	3,681,508.80	34,366.10	2,176,979.48	159,556.63

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项需要说明。

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

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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大事项停牌	9.06	-	-	100,000	1,010,000.00	906,000.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项停牌	11.55	-	-	100	1,450.00	1,155.00	-

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

-

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
合计				-	-

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

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。

6.4.10 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2018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 33,762,873.06 元,属于第二层次的余额为 2,899,155.00 元,无属于第三层次的余额。

(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。

§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	34,670,028.06	66.12
	其中:股票	34,670,028.06	66.12
2	固定收益投资	1,992,000.00	3.80
	其中:债券	1,992,000.00	3.80
	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	10,000,000.00	19.07
	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	5,596,223.00	10.67
7	其他各项资产	176,172.35	0.34
8	合计	52,434,423.41	100.00

7.2 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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,595,485.51	24.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,015,810.00	9.67
E	建筑业	941,009.55	1.81
F	批发和零售业	6,758,672.60	13.03
G	交通运输、仓储和邮政业	5,239,377.10	10.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	960,838.50	1.85
J	金融业	12,279.00	0.02
K	房地产业	2,088.00	0.00
L	租赁和商务服务业	1,062,269.00	2.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,199.00	0.01
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	2,078,999.80	4.01
S	综合	-	-
	合计	34,670,028.06	66.85

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期无港股通股票投资。

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	600270	外运发展	249,871	5,237,296.16	10.10
2	600859	王府井	137,600	2,926,752.00	5.64
3	002029	七匹狼	358,261	2,862,505.39	5.52
4	600886	国投电力	372,700	2,709,529.00	5.22
5	600060	海信电器	195,600	2,619,084.00	5.05
6	601139	深圳燃气	238,740	1,325,007.00	2.55
7	600757	长江传媒	210,700	1,198,883.00	2.31
8	000417	合肥百货	195,300	1,122,975.00	2.17
9	603001	奥康国际	93,497	1,113,549.27	2.15
10	600697	欧亚集团	50,000	1,064,500.00	2.05

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

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	002029	七匹狼	3,178,988.90	0.72
2	600060	海信电器	2,994,415.00	0.67
3	600859	王府井	2,990,255.00	0.67
4	600886	国投电力	2,647,924.00	0.60
5	002385	大北农	2,613,292.22	0.59
6	000848	承德露露	2,367,867.00	0.53
7	002022	科华生物	1,671,535.00	0.38
8	002394	联发股份	1,499,099.10	0.34
9	000726	鲁泰A	1,498,884.00	0.34
10	000625	长安汽车	1,458,500.00	0.33
11	000498	山东路桥	1,433,200.00	0.32
12	600757	长江传媒	1,389,639.00	0.31
13	000417	合肥百货	1,380,319.00	0.31
14	601139	深圳燃气	1,360,860.00	0.31
15	603001	奥康国际	1,336,620.13	0.30
16	601818	光大银行	1,290,000.00	0.29
17	002521	齐峰新材	1,236,402.00	0.28
18	600697	欧亚集团	1,235,000.00	0.28
19	002241	歌尔股份	1,112,461.00	0.25
20	601566	九牧王	1,110,603.00	0.25

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。

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	600612	老凤祥	12,901,063.00	2.90
2	600028	中国石化	11,958,019.00	2.69
3	600598	北大荒	10,806,021.00	2.43
4	002462	嘉事堂	10,392,062.50	2.34
5	000860	顺鑫农业	10,044,345.81	2.26
6	601668	中国建筑	9,386,806.00	2.11
7	600085	同仁堂	8,922,792.00	2.01
8	300083	劲胜智能	8,117,133.00	1.83
9	600688	上海石化	7,769,062.84	1.75
10	002262	恩华药业	6,757,085.00	1.52
11	000895	双汇发展	6,520,489.00	1.47
12	601965	中国汽研	6,128,174.00	1.38
13	600068	葛洲坝	5,273,193.00	1.19
14	002206	海利得	4,141,379.00	0.93
15	000848	承德露露	2,484,358.10	0.56
16	000423	东阿阿胶	2,297,756.00	0.52
17	300129	泰胜风能	2,279,093.00	0.51
18	600270	外运发展	2,240,187.85	0.50
19	002385	大北农	1,525,223.00	0.34
20	000726	鲁泰A	1,490,061.00	0.34

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。

7.4.3 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

买入股票成本(成交)总额	45,213,891.36
卖出股票收入(成交)总额	139,891,702.25

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。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,992,000.00	3.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,992,000.00	3.84

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	143928	17平租Y1	20,000	1,992,000.00	3.84

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

7.11.2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)					0.00
国债期货投资本期收益(元)					0.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					0.00

注:本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.3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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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。

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	55,606.16
2	应收证券清算款	61,524.63
3	应收股利	-
4	应收利息	59,041.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	176,172.35

7.12.4 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。

7.12.5 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。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
中银证券瑞益混合A	1,054	43,036.28	10,008,922.57	22.07%	35,351,315.76	77.93%
中银证券瑞益混合C	219	21,976.96	1,000,534.72	20.79%	3,812,420.25	79.21%
合计	1,273	39,413.35	11,009,457.29	21.94%	39,163,736.01	78.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本期末本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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

注:本期末本基金管理人的从业人员未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	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年1月25日)基金份额总额	613,712,711.19	21,530,819.20
本报告期期初基金份额总额	419,060,403.62	4,621,506.92
本报告期基金总申购份额	2,067,983.80	1,574,404.74
减:本报告期基金总赎回份额	375,768,149.09	1,382,956.69
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,360,238.33	4,812,954.97

注:本基金合同于2017年1月25日生效。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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

中银国际证券股份有限公司董事长由高迎新变更为林景臻。

中银国际证券股份有限公司董事由潘其方变更为廖胜森。

基金托管人的专门基金托管部门的无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

一、本报告期内,涉及基金管理人的诉讼事项如下:

1. 上海普鑫投资管理有限公司因正当财产保全权利的实施是否受阻碍争议诉中银国际证券财产损害赔偿纠纷案,该案于2011年开始诉讼程序,2018年3月1日,上海市一中院作出(2018)沪01执复23号执行裁定书,驳回中银国际证券复议申请,执行法院扣划执行加倍债务利息3107409.55元。案件已执行结案。

2. 郑宇因指令未接受撤销争议诉中银国际证券武汉黄孝河路证券营业部证券交易合同纠纷案,该案于2017年7月开始诉讼程序。2018年3月28日,武汉市中级人民法院作出“(2018)鄂01民终557号”民事判决书,驳回郑宇上诉请求,维持原判,即驳回原告郑宇的全部诉讼请求。

3. 彭阳因不服2017年9月27日武汉市劳动人事争议仲裁委员会作出的关于劳动争议的仲裁结果,诉中银国际证券武汉黄孝河路营业部。2018年4月24日,武汉市中级人民法院作出(2018)鄂01民终1836号民事判决书,驳回上诉。

4. 2018年4月底,中银国际证券将股票质押式回购交易违约债务人刘德群诉至深圳市福田区人民法院,申请拍卖、变卖刘德群持有的已质押给中银国际证券的股票。2018年6月,中银国际证券从深圳福田区人民法院申请撤诉。

5. 中银国际证券于2018年4月底将股票质押式回购交易违约债务人天津顺航海运有限公司诉至天津市第二中级人民法院。2018年5月,双方已达成调解。

二、本报告期内,无涉及基金财产的诉讼事项;

三、本报告期内,无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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。

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

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。

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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
中银国际	2	184,356,798.60	100.00%	134,810.55	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。

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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
中银国际	85,209,075.77	100.00%	1,186,296,000.00	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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年3月1日	299,999,000.00	0.00	299,999,000.00	0.00	0.00%
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。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无

中银国际证券股份有限公司

2018年8月28日