中银证券聚瑞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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	中银证券聚瑞混合	
基金主代码	004913	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017年11月29日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,548,517.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中银证券聚瑞混合A	中银证券聚瑞混合C
下属分级基金的交易代码:	004913	004914
报告期末下属分级基金的份额总额	93,695,403.27份	6,853,113.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极挖掘市场投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、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	中证800指数收益率*25%+中债综合全价指数收益率*70%+同期银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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		中银国际证券股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵向雷	胡波
	联系电话	021-20328000	021-61618888
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		021-61195566,400-620-8888	95528
传真		021-50372474	021-63602540

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	中银证券聚瑞混合A	中银证券聚瑞混合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	-398,832.40	-279.33
本期利润	-2,308,040.87	-110,668.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0224	-0.0096
本期基金份额净值增长率	-2.47%	-2.60%
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	-0.0216	-0.0229
期末基金资产净值	91,675,387.22	6,695,925.37
期末基金份额净值	0.9784	0.9771

注:1、本基金合同于2017年11月29日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

4、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。

3.2 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

中银证券聚瑞混合A

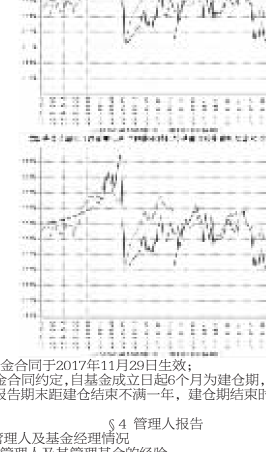
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.24%	0.32%	-1.81%	0.34%	0.57%	-0.02%
过去三个月	-2.06%	0.32%	-2.16%	0.29%	0.10%	0.03%
过去六个月	-2.47%	0.36%	-2.04%	0.29%	-0.43%	0.07%
自基金合同生效起至今	-2.16%	0.33%	-2.14%	0.28%	-0.02%	0.05%

中银证券聚瑞混合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	-1.24%	0.32%	-1.81%	0.34%	0.57%	-0.02%
过去三个月	-2.08%	0.32%	-2.16%	0.29%	0.08%	0.03%
过去六个月	-2.60%	0.36%	-2.04%	0.29%	-0.56%	0.07%
自基金合同生效起至今	-2.29%	0.33%	-2.14%	0.28%	-0.15%	0.05%

注:业绩比较基准=中证800指数收益率*25%+中债综合全价指数收益率*70%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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11月29日生效;

2、按照基金合同约定,自基金成立日起6个月为建仓期,截止本报告期末,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		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年11月29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、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。
沈龙	本基金基金经理	2017年11月29日	-	9	沈龙先生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。2006年1月至2006年10月任职于华为技术有限公司,从事WCDMA产品开发与测试。2006年10月至2008年2月任职于电子资讯系统(上海)有限公司,从事通用汽车(美国)多个应用系统的技术支持与维护。2008年2月至2015年9月任职于太平养老保险股份有限公司投资管理中心,先后担任TMT行业研究员、投资经理助理、投资经理。2015年9月加盟中银国际证券基金管理部,现任中银国际证券中国红债券宝投资主办人、中银国际证券中国红基金宝投资主办人、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、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈渭泉	本基金基金经理	2018年1月31日	-	11	陈渭泉,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。2004年8月至2006年3月任职于北京玖方量子科技有限公司,任金融工程研究员;2006年3月至2008年9月任职于天相投资顾问有限公司,任宏观与固定收益研究员;2008年10月至2009年12月任职于华泰柏瑞基金管理有限公司,任固定收益研究员;2009年12月至2017年5月任职于长江养老保险股份有限公司,先后担任固定收益研究员、投资经理助理、投资经理;2017年5月加入中银国际证券股份有限公司,现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基金经理。
白冰洋	本基金基金经理	2018年1月13日	-	8	白冰洋,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。历任台湾群益证券研究员。2012年加盟中银国际证券股份有限责任公司,历任中银证券保本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1号投资主办人、中国红基金宝投资主办人、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年上半年,债券市场表现总体良好。年初至1月中旬,受资金面紧张以及美联储加息预期的影响,收益率快速上行;1月中旬以来,受去杠杆政策导致的紧信用的影响,宏观经济总体下行;加之随着中美贸易摩擦逐步升级,市场避险情绪增大。鉴于此,央行先后两次降低存款准备金率,并且没有跟随美联储加息,市场资金面总体宽松。因此一月中旬以来利率债和中高等级信用债收益率震荡下行。但另一方面,在去杠杆和资管新规出台的背景下,企业融资渠道受限,信用事件有所抬头,市场信用风险厌恶情绪明显上升,中高等级信用债和低等级信用债利差分化明显。

上半年,固定收益投资方面,本产品主要对存单、可转债和利率债进行了灵活的波段操作,在资金宽松的时候阶段性地运用了杠杆操作。

权益投资方面,2018年一季度市场呈现出较大的波动特征。大盘蓝筹、消费白马,周期行业经历了先涨后跌,而创业板则呈现出先跌后涨的局面。2018年二季度市场呈现超市场预期的大幅下跌,无论上证综指、创业板指都无一例外。大盘蓝筹、周期行业经历了一季度的先涨后跌,二季度上半期短暂企稳后继续下跌。创业板则在一季度先跌后涨之后,二季度大幅下跌。这一特征大大区别于以往年度的情况。上半年市场没有所谓的大小盘之类的风格特征,最强烈的特征是避险,表现为轻资产、现金流较好的白酒、部分医药表现持续突出。

整体而言,上半年整体呈现的持续下跌可能由于以下因素:对未来经济增速向下的担忧,去杠杆带来的综合影响,对地产和贸易战的担忧。表现为,有业绩的周期类公司,担心其现金流、债务情况或者未来业绩;中小创公司中部分受到贸易战影响,业绩增速和估值依然不匹配。

我们在年初就在一定程度认识到2018年投资风险和难度都可能较大的特征。本产品坚持以价值判断为基础,在波动较大的市场中控制风险。自上而下与自下而上的投资方法相结合选择投资标的,努力为客户获取中长期收益。

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聚瑞混合A基金份额净值为0.9784元,本报告期基金份额净值增长率为-2.47%;截至本报告期末中银证券聚瑞混合C基金份额净值为0.9771元,本报告期基金份额净值增长率为-2.60%;同期业绩比较基准收益率为-2.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年固定收益市场,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,但下行空间或将有限;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。

展望2018年下半年权益市场,我们认为机会与挑战并存。

挑战在于,压制上半年市场表现的去杠杆的宏观环境和贸易战的外部影响依然存在。机会在于:1.政策边际上有所变化,一定程度上有利于稳定市场对经济的预期。2.市场经过调整,已经部分释放了风险。3.无风险收益率近期有所下降。

长期来看,权益资产在大类资产配置中仍有优势。可能出现的亮点仍然在于改革的持续推进带来的红利。市场整体的预期收益率可能会降低,但整体而言权益资产在大类资产配置中仍有优势。在日益复杂的环境下,我们将继续发挥专业特长,灵活调整仓位和优化配置,更好的管理我们的风险和收益。审慎投资、勤勉尽责,为持有人谋求长期、稳定的回报。

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

中银证券聚瑞混合A基金:本报告期内未实施利润分配。

中银证券聚瑞混合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

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对中银证券聚瑞混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对中银证券聚瑞混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由中银国际证券股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:中银证券聚瑞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		22,153,218.36	589,201.50
结算备付金		404,910.66	1,088,492.96
存出保证金		49,169.89	240.72
交易性金融资产		60,193,874.65	45,077,700.00
其中:股票投资		20,682,358.62	-
基金投资		-	-
债券投资		39,511,516.03	45,077,700.00
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		34,375,124.99	203,996,710.59
应收证券清算款		-	-
应收利息		885,326.77	988,253.66
应收股利		-	-
应收申购款		792.08	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		118,062,417.40	251,740,599.43
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		8,000,000.00	-
应付证券清算款		11,419,723.39	81,136.99
应付赎回款		13,532.09	-
应付管理人报酬		49,354.13	127,893.18
应付托管费		8,225.68	21,315.53
应付销售服务费		562.15	10,980.46
应付交易费用		9,431.85	935.59
应交税费		4,639.33	-
应付利息		-6,574.47	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		192,210.66	49,998.00
负债合计		19,691,104.81	292,259.75
所有者权益:			
实收基金		100,548,517.02	250,646,631.23
未分配利润		-2,177,204.43	801,708.45
所有者权益合计		98,371,312.59	251,448,339.68
负债和所有者权益总计		118,062,417.40	251,740,599.43

注:报告截止日2018年6月30日,中银证券聚瑞混合A基金份额净值0.9784元,基金份额总额93,695,403.27份;中银证券聚瑞混合C基金份额净值0.9771元,基金份额总额6,853,113.75份。中银证券聚瑞混合份额总额合计为100,548,517.02份。

6.2 利润表

会计主体:中银证券聚瑞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1日至2017年6月30日
一、收入		-1,552,935.31	-
1.利息收入		1,953,537.88	-
其中:存款利息收入		52,476.58	-
债券利息收入		1,386,224.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		514,837.03	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,588,095.86	-
其中:股票投资收益		-2,248,439.26	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		124,385.89	-
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		535,957.51	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,019,597.17	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		101,219.84	-
减:二、费用		865,773.59	-
1. 管理人报酬		339,000.90	-
2. 托管费		56,500.15	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	5,577.49	-
4. 交易费用		192,789.29	-
5. 利息支出		77,186.91	-
其中:卖出回购金融资产支出		77,186.91	-
6. 其他费用		190,270.36	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-2,418,708.90	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-2,418,708.90	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银证券聚瑞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)	250,646,631.23	801,708.45	251,448,339.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-2,418,708.90	-2,418,708.90
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)	-150,098,114.21	-560,203.98	-150,658,318.19
其中:1.基金申购款	842,444.88	1,842.27	844,287.15
2.基金赎回款	-150,940,559.09	-562,046.25	-151,502,605.34
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)	100,548,517.02	-2,177,204.43	98,371,312.59
项目	上年度可比期间 2017年1月1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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

中银证券聚瑞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[2017]1045号《关于准予中银证券聚瑞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《中银证券聚瑞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250,519,194.34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1008号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券聚瑞混合型证券投资基金基金合同》于2017年11月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为250,646,631.23份基金份额,其中认购资金利息折合127,436.89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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"浦发银行")。

根据《中银证券聚瑞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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券聚瑞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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券、超短期融资券等)、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的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0% - 45%。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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。业绩比较基准为:中证800指数收益率*25%+中债综合全价指数收益率*70%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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(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》、《中银证券聚瑞混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止期间的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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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
上海浦东发展银行股份有限公司("浦发银行")	基金托管人、基金销售机构
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		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
中银证券	150,509,963.50	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		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中银证券	72,768,792.99	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		上年度可比期间 2017年1月1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	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中银证券	832,500,000.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

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	110,067.78	100.00%	4,441.63	100.00%
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
-	-	-	-	-

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1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	339,000.90	-
其中:支付销售机构的客户维护费	157,384.36	-

注:支付基金管理人中银证券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 X 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	56,500.15	-

注:支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 X 0.10% / 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		
	中银证券聚瑞混合A	中银证券聚瑞混合C	合计
中国银行	-	578.86	578.86
中银证券	-	4,855.48	4,855.48
合计	-	5,434.34	5,434.34
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		
	中银证券聚瑞混合A	中银证券聚瑞混合C	合计
-	-	-	-

注:支付基金销售机构的中银证券聚瑞混合型证券投资基金C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中银证券,再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

C类基金份额日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 0.1%/ 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

注:本基金本报告期内未与关联方进行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

注:本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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:本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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		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
浦发银行	22,153,218.36	32,407.42	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管,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:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末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

注:本基金本报告期期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

-

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额8,000,000.00元,于2018年7月26日到期。该类交易要求基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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25,464,103.85元,属于第二层次的余额为34,729,770.80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。

(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	20,682,358.62	17.52
	其中:股票	20,682,358.62	17.52
2	固定收益投资	39,511,516.03	33.47
	其中:债券	39,511,516.03	33.47
	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	34,375,124.99	29.12
	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	22,558,129.02	19.11
7	其他各项资产	935,288.74	0.79
8	合计	118,062,417.40	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	8,345,494.94	8.48
C	制造业	8,658,901.12	8.80
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	3,677,962.56	3.74
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	20,682,358.62	21.02

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:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600028	中国石化	907,606	5,890,362.94	5.99
2	600339	中油工程	546,800	2,455,132.00	2.50
3	600062	华润双鹤	99,200	2,435,360.00	2.48
4	601288	农业银行	682,649	2,348,312.56	2.39
5	002020	京新药业	156,200	1,840,036.00	1.87
6	601939	建设银行	203,000	1,329,650.00	1.35
7	600760	中航沈飞	33,203	1,196,636.12	1.22
8	600562	国睿科技	53,300	914,095.00	0.93
9	002013	中航机电	111,120	841,178.40	0.86
10	601003	柳钢股份	70,400	557,568.00	0.57

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	600028	中国石化	10,477,890.00	4.17
2	600060	海信电器	3,883,162.00	1.54
3	601939	建设银行	3,783,752.00	1.50
4	601288	农业银行	3,640,401.00	1.45
5	601336	新华保险	3,277,022.00	1.30
6	601699	潞安环能	3,150,576.00	1.25
7	601398	工商银行	3,010,264.00	1.20
8	601818	光大银行	3,004,319.00	1.19
9	600048	保利地产	2,571,153.00	1.02
10	600062	华润双鹤	2,556,813.00	1.02
11	600339	中油工程	2,556,251.00	1.02
12	601003	柳钢股份	2,149,571.40	0.85
13	600760	中航沈飞	1,890,921.00	0.75
14	600466	蓝光发展	1,842,989.00	0.73
15	000581	威孚高科	1,760,650.00	0.70
16	000521	长虹美菱	1,678,938.00	0.67
17	002020	京新药业	1,675,004.00	0.67
18	600161	天坛生物	1,530,552.00	0.61
19	002262	恩华药业	1,454,741.49	0.58
20	300182	捷成股份	1,452,065.59	0.58

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	600028	中国石化	3,936,968.86	1.57
2	600060	海信电器	3,608,738.34	1.44
3	601336	新华保险	3,263,847.22	1.30
4	601699	潞安环能	3,146,086.27	1.25
5	601398	工商银行	2,902,503.00	1.15
6	601818	光大银行	2,889,532.24	1.15
7	600048	保利地产	2,369,202.85	0.94
8	002262	恩华药业	2,147,331.79	0.85
9	601939	建设银行	2,036,928.00	0.81
10	000521	长虹美菱	1,706,281.19	0.68
11	000581	威孚高科	1,624,050.00	0.65
12	601003	柳钢股份	1,586,506.60	0.63
13	600466	蓝光发展	1,482,687.25	0.59
14	300182	捷成股份	1,472,214.93	0.59
15	600161	天坛生物	1,409,915.00	0.56
16	300121	阳谷华泰	1,383,512.40	0.55
17	600967	内蒙一机	1,338,575.00	0.53
18	601997	贵阳银行	1,285,200.00	0.51
19	601328	交通银行	1,154,661.55	0.46
20	601088	中国神华	1,140,766.00	0.45

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	87,053,747.37
卖出股票收入(成交)总额	63,456,216.13

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	5,353,740.00	5.44
	其中:政策性金融债	5,353,740.00	5.44
4	企业债券	24,347,030.80	24.75
5	企业短期融资券	5,029,000.00	5.11
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,781,745.23	4.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,511,516.03	40.17

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	122494	15华夏05	70,000	6,300,700.00	6.41
2	011800020	18辽成大SCP001	50,000	5,029,000.00	5.11
3	110033	国贸转债	45,310	4,713,599.30	4.79
4	136329	16国美03	48,000	4,703,520.00	4.78
5	112682	18苏宁01	40,000	3,946,000.00	4.01

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

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:本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2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,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。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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:本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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

本基金持有的"国贸转债"的发行主体厦门国贸集团股份有限公司于2017年8月23日收到厦门证监局出具的《关于对厦门国贸集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》,因违反上市公司信息披露规则等,决定对发行主体采取责令改正监督管理措施,并提出部分整改要求。发行主体于2017年12月20日收到上海证券交易所出具的《关于对厦门国贸集团股份有限公司及董事会秘书陈晓华予以通报批评的决定》([2017]75号),因违反《股票上市规则》等,上海证券交易所对厦门国贸集团股份有限公司及董事会秘书陈晓华予以通报批评、并通报中国证监会、计入上市公司诚信档案。

本基金持有的"16国美03"的发行主体国美电器有限公司于2018年2月1日收到北京市工商行政管理局西城分局出具的京工商西处字(2018)第119号,北京市工商行政管理局西城分局依据《流通领域商品质量监督管理办法》第三十条及《中华人民共和国产品质量法》第四十九条的规定 对发行主体:1、没收违法所得5294.02元;2、罚款109480元。

信评团队负责对证券进行信用分析和筛选入池。基金经理通过对宏观经济、货币市场资金面和基金的持仓情况进行分析,决定证券投资的期限、品种和数量,在符合规定的证券池内选择合适的证券进行投资。

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	49,169.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	885,326.77
5	应收申购款	792.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	935,288.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110033	国贸转债	4,713,599.30	4.79
2	128013	洪涛转债	68,145.93	0.07

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	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
中银证券聚瑞混合A	830	112,886.03	496,372.03	0.53%	93,199,031.24	99.47%
中银证券聚瑞混合C	107	64,047.79	3,002,187.50	43.81%	3,850,926.25	56.19%
合计	937	107,308.98	3,498,559.53	3.48%	97,049,957.49	96.52%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中银证券聚瑞混合A	0.00	0.0000%
	中银证券聚瑞混合C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

注:期末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

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	中银证券聚瑞混合A	0
	中银证券聚瑞混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券聚瑞混合A	0
	中银证券聚瑞混合C	0
	合计	0

注:期末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	中银证券聚瑞混合A	中银证券聚瑞混合C
基金合同生效日(2017年11月29日)基金份额总额	125,555,993.71	125,090,637.52
本报告期期初基金份额总额	125,555,993.71	125,090,637.52
本报告期基金总申购份额	309,872.18	532,572.70
减:本报告期基金总赎回份额	32,170,462.62	118,770,096.47
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	93,695,403.27	6,853,113.75

注:本基金合同于2017年11月29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。

上海浦东发展银行股份有限公司孔建先生担任公司资产托管部总经理,主持资产托管部相关工作。

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证券营业部。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		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	2	150,509,963.50	100.00%	110,067.78	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		债券回购交易		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
中银国际	72,768,792.99	100.00%	832,500,000.00	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

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