

# 中银瑞利灵活配置混合型证券投资基金

# 2019年半年度报告摘要

基金管理人：中银基金管理有限公司  
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一九年八月二十六日

## 1 重要提示

基金管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。  
基金管理人的诚信承诺及风险揭示不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金财产，但不保证基金一定盈利。  
基金管理人的诚信承诺及风险揭示不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，自2019年8月23日生效。基金合同的任何修订均在基金份额持有人大会通过后方能生效。

本报告期内未出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情况。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

## 2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金名称 中银瑞利混合

基金代码 002413

交易代码 002413

基金管理人方式 签约开放式基金

基金合同生效日 2016年2月4日

基金托管人 中银基金管理有限公司

基金销售机构 上海浦东发展银行股份有限公司

报告期初基金资产总额 521,410,512.14

下属分级基金的基本情况

中银瑞利混合A 中银瑞利混合C

下属分级基金的交易代码 002413 002414

报告期末下属分级基金的份额总额 515,001,260.01份 6,329,252.13份

**2.2 基金产品说明**

**投资目标** 本基金在严格风险控制的前提下，通过科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析及对行业精选策略，结合大类资产配置策略，追求基金资产的长期稳健增长。

**投资策略** 本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的主动投资策略，其中，本基金将综合运用定性分析和定量分析于大类资产配置、行业配置和个券选择，构建投资组合。

**业绩比较基准** 沪深300指数收益率×60%+中证债券指数收益率×40%

报告期末基金份额净值 0.9985

**风险收益特征** 本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金，属于中等风险水平的投資品种。

**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 中银基金管理有限公司 上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露负责人 姚文成 胡波

联系电话 021-36161888

电子邮箱 clfundservice@zhcm.com

客户服务电话 021-38834788 95528

传真 021-68973498 021-63605240

**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.zbcom.com

基金半年度报告备置地点 上海市浦东新区银城中路200号26楼

**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

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

中银瑞利混合A 中银瑞利混合C

本期实现收益 7,391,768.72 90,341.56

本期利润 46,415,278.16 566,633.17

加权平均基金份额本期利润 0.0901 0.0985

本期基金份额变动率 9.32% 9.32%

3.2 本期末数据和指标

中银瑞利混合A 中银瑞利混合C

期末可供分配基金份额利润 -0.0267 -0.0267

期末基金资产净值 544,133,346.03 6,698,375.15

期末基金资产净值 1.066 1.056

注：1.上述基金净值是指不包括认申购交易费用的各项费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

4. 资产负债表中所列项目的含义与会计报表项目的含义可能不同，具体含义参见本报告附注“重要提示”和“会计报表主要项目附注”。

5. 本期利润是根据有关基金规定，将本期利润减去基金公允价值变动收益后的余额。

6. 本期末可供分配利润即为未分配利润，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

7. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

8. 资产负债表中所列项目的含义与会计报表项目的含义可能不同，具体含义参见本报告附注“重要提示”和“会计报表主要项目附注”。

9. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

10. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

11. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

12. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

13. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

14. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

15. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

16. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

17. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

18. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

19. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

20. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

21. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

22. 期末可供分配利润不包括持有人认购交易费用的累计费用，计算时采用实际收益

水平来确定的全部数据。

23. 本期末可供分配利润即为未实现部分，即期可得利润部分为负数，则本期可供分配利润的金额为期初可供分配利润(已实现部分)减去未实现部分。

24. 管理人报告

4.1 基金管理人对本基金年度报告分析

4.1.1 基金管理人的基本情况

本基金基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国国际金融有限公司和贝莱德投资管理有限公司共同出资设立的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力为长期投资者创造价值。

4.1.2 基金管理人对报告期内基金运作的评价

截至2019年6月30日，本基金管理人共管理旗下10只基金，其中6只股票型基金、3只混合型基金、1只债券型基金、1只货币型基金。

4.1.3 基金管理人对基金年度报告编制的说明

本报告期内，基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》的有关规定，完成了年度报告的编制工作。

4.2 管理人对基金年度报告基本意见

本基金年度报告真实、准确、完整地反映了本基金本年度的经营成果，能够真实、准确、完整地反映本基金本年度的经营成果。

4.3 管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.1 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.2 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.3 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.4 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.5 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.6 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.7 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.8 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.9 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.10 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.11 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.12 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.13 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.14 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.15 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.16 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.17 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.18 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.19 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.20 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.21 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.22 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.23 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.24 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.25 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.26 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.27 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.28 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.29 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.30 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.31 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.32 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.33 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.34 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.35 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.36 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.37 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.38 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.39 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.40 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.41 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.42 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明

4.3.43 基金管理人对基金年度报告中重要事项的说明