

**国投瑞银纯债债券型证券投资基金**  
**2017 年半年度报告摘要**  
**2017 年 6 月 30 日**

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 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            | 国投瑞银纯债债券           |                    |
| 基金主代码           | 121013             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2012 年 12 月 11 日   |                    |
| 基金管理人           | 国投瑞银基金管理有限公司       |                    |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司         |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 1,950,820,118.00 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 国投瑞银纯债债券 A         | 国投瑞银纯债债券 B         |
| 下属分级基金的交易代码     | 121013             | 128013             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 38,387,566.84 份    | 1,912,432,551.16 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，力争在长期中实现超越业绩比较基准的投资业绩，为投资者提供低波动、稳健回报的理财工具。   |
| 投资策略   | <p>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。</p> <p>本基金基于均衡收益率曲线进行基本价值评估，计算不同资产类别、不同剩余期限债券品种的预期超额回报，并对预期超额回报进行排序，得到投资评级。在此基础上，卖出内部收益率低于均衡收益率的债券，买入内部收益率高于均衡收益率的债券。</p> <p>债券投资策略主要包括：久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为纯债债券型基金，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 | 中国银行股份有限公司 |

|             |      |                     |                      |
|-------------|------|---------------------|----------------------|
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘凯                  | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 400-880-6868        | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | service@ubssdic.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-880-6868        | 95566                |
| 传真          |      | 0755-82904048       | 010-66594942         |

## 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 | <a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a> |
| 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日） |                  |
|---------------|--------------------------------------|------------------|
|               | 国投瑞银纯债债券 A                           | 国投瑞银纯债债券 B       |
| 本期已实现收益       | -76,978.79                           | -11,417,572.42   |
| 本期利润          | 489,922.43                           | 26,544,796.09    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0181                               | 0.0066           |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.66%                                | 1.75%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |                  |
|               | 国投瑞银纯债债券 A                           | 国投瑞银纯债债券 B       |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0104                              | -0.0099          |
| 期末基金资产净值      | 39,992,320.35                        | 1,993,412,658.91 |
| 期末基金份额净值      | 1.042                                | 1.042            |

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

##### 国投瑞银纯债债券 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      | 2.16%    | 0.14%       | 0.90%      | 0.06%         | 1.26%  | 0.08%  |
| 过去三个月      | 1.16%    | 0.12%       | -0.88%     | 0.08%         | 2.04%  | 0.04%  |
| 过去六个月      | 1.66%    | 0.09%       | -2.11%     | 0.08%         | 3.77%  | 0.01%  |
| 过去一年       | 3.27%    | 0.09%       | -3.50%     | 0.10%         | 6.77%  | -0.01% |
| 过去三年       | 17.86%   | 0.11%       | 2.70%      | 0.10%         | 15.16% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 22.39%   | 0.11%       | 2.84%      | 0.09%         | 19.55% | 0.02%  |

##### 国投瑞银纯债债券 B

| 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      | 2.16%    | 0.14%       | 0.90%      | 0.06%         | 1.26%  | 0.08%  |
| 过去三个月      | 1.26%    | 0.12%       | -0.88%     | 0.08%         | 2.14%  | 0.04%  |
| 过去六个月      | 1.75%    | 0.09%       | -2.11%     | 0.08%         | 3.86%  | 0.01%  |
| 过去一年       | 3.42%    | 0.09%       | -3.50%     | 0.10%         | 6.92%  | -0.01% |
| 过去三年       | 18.59%   | 0.11%       | 2.70%      | 0.10%         | 15.89% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 23.39%   | 0.11%       | 2.84%      | 0.09%         | 20.55% | 0.02%  |

注：本基金为纯债债券型基金，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。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

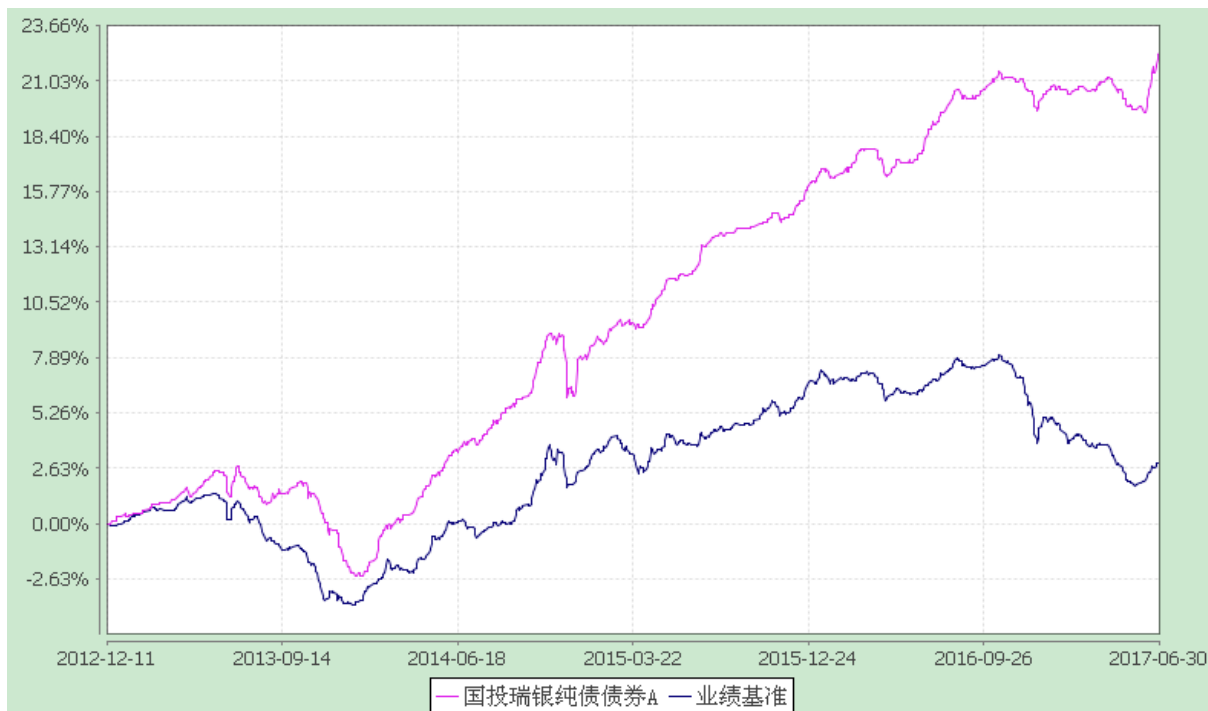
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 国投瑞银纯债债券型证券投资基金

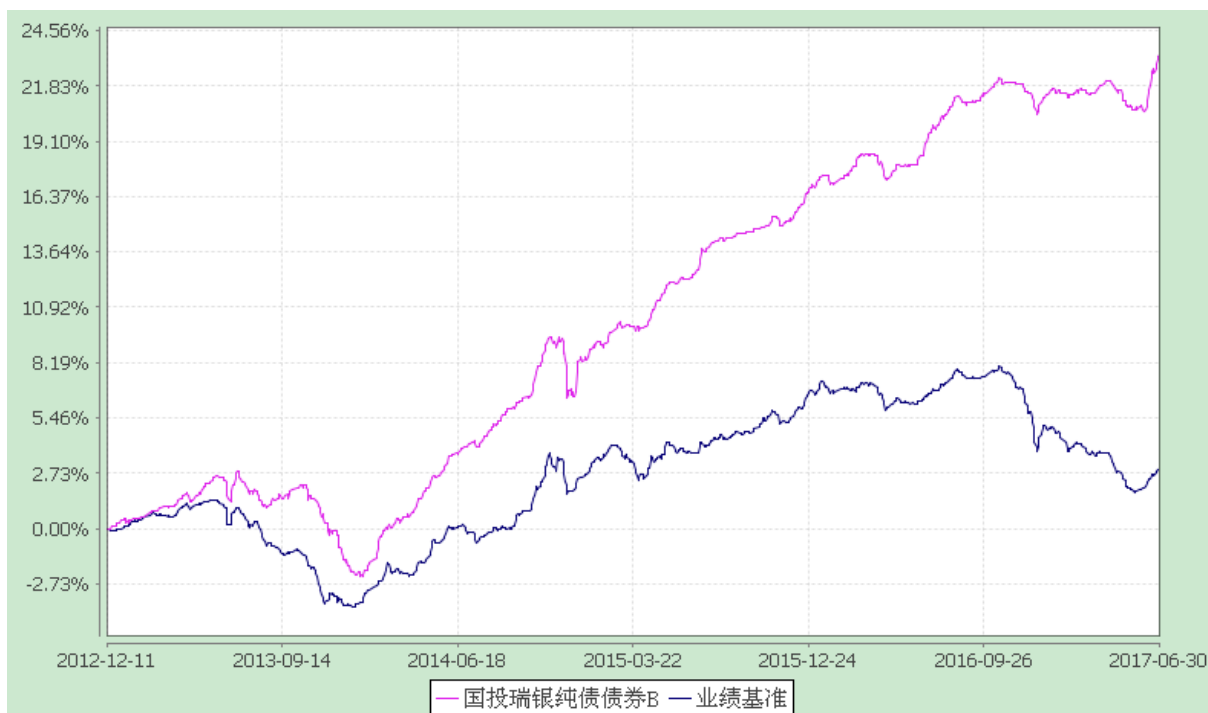
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 12 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日)

##### 国投瑞银纯债债券 A



国投瑞银纯债债券 B



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 日正式成立，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 2017 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 66 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 和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 |        |  |
| 蔡玮菁 | 本基金基金经理、固定收益部副总监 | 2015-08-25      | -    | 13     | 中国籍，硕士，具有基金从业资格，曾任光大证券、浦东发展银行、太平养老保险。2012 年 9 月加入国投瑞银，现任国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金、国投瑞银纯债债券型证券投资基金、国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金和国投瑞银瑞祥保本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合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银纯债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，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，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，形成了有效地公平交易体系。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

报告期内债券市场经历了过山车式的行情，收益率先上后下，宽幅震荡。3月下旬以后，监管部门密集发文抑制金融杠杆，特别是银监会的 334 文件引发了市场担忧，同时委外集中赎回也极大冲击市场情绪。各期限品种收益率迅速走高。4 月份公布的一季度经济数据和 3 月金融数据超出市场预期，助推了收益率涨幅。5 月份市场对监管预期仍很强烈，叠加债市流动性冲击，10 年国开收益率在五月上旬一度上探到 4.38%，随后收益率呈现高位钝化，在维持了一段时间平稳后开始小幅度下行，后呈现区间震荡。进入 6 月后，随着监管政策边际缓和，央行喊话呵护季末资金面后，市场情绪开始有所好转。5 月经济金融数据出笼后市场焦点转为博弈基本面走弱倒逼货币政策边际放松，收益率快速下行。10 年国开收益率下行达到 20bp，收益率曲线呈平坦化下移。



信用债基本跟随利率债走势，期限利差收窄，信用利差先扩大再收窄。本基金 4 月份减持利率债，维持中短久期，在市场反弹时拉长了久期。

#### 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 1.042 元，B 级份额净值为 1.042 元，本报告期 A 级份额净值增长率为 1.66%，B 级份额净值增长率为 1.75%，同期业绩比较基准收益率均为-2.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，随着各项监管政策的推进，包括金融去杠杆、房地产限购政策等，三季度以后的经济增速将面临重新下滑的压力。货币政策目前来看难以转向，短期经济数据支持央行继续执行中性的货币政策，但下半年经济下滑的压力以及十九大召开的敏感时期，不排除可能成为促使央行边际放松货币政策的因素。而之前影响债市最重要的因素—监管政策，未来是否会继续进一步加强，则取决于银行的自查结果与监管目标之间的差距。我们倾向于认为从一些数据（如 M2 增速、理财存量下降、金融负债同比持续下降等）来观察，金融杠杆虽未完全出清，但也已初见成效。考虑到未来经济下滑，海外主要央行货币政策存在不确定性等因素的影响，监管向更严格方向演进的可能性并不大。

目前债券收益率处于过去十年以来中性的水平，而无论是 GDP 还是工业增加值都处于同时期的较低水平。结合目前的估值水平、未来走弱的经济数据和较低的通胀环境，债券收益逐步具备投资价值。如果三季度再次受流动性冲击的影响出现收益率上升的话，债券将迎来趋势性投资机会。

#### 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合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估，并对基金估值程序进行监督；估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等事项，估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以及监察稽核部指定人员；运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，设立基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关

成员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。

本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值小组提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管行沟通，在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、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

本基金 A 类份额本期已实现收益为-76,978.79 元，期末可供分配利润为-398,287.97 元；报告期内本基金 A 类共实施 1 次收益分配，累计分配 140,562.11 元，每 10 份基金份额分红 0.060 元。

B 类份额本期已实现收益为-11,417,572.12 元，期末可供分配利润为-18,871,409.07 元；报告期内本基金 B 类共实施 1 次收益分配，累计分配 33,347,654.27 元，每 10 份基金份额分红 0.070 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国投瑞银纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 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：国投瑞银纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      | -                              | -                                |
| 银行存款            | 16,138,634.82                  | 19,889,600.85                    |
| 结算备付金           | 3,650,677.56                   | 1,462,684.92                     |
| 存出保证金           | 71,159.24                      | 34,197.81                        |
| 交易性金融资产         | 2,597,466,232.67               | 4,907,901,103.66                 |
| 其中：股票投资         | -                              | -                                |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 2,597,466,232.67               | 4,907,901,103.66                 |
| 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        | -                              | 407,910,000.00                   |
| 应收证券清算款         | -                              | -                                |
| 应收利息            | 51,570,457.36                  | 56,482,662.84                    |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 169,565.28                     | 25,868.00                        |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | 11,250.00                      | 11,250.00                        |
| 资产总计            | 2,669,077,976.93               | 5,393,717,368.08                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      | -                              | -                                |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 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     | 630,298,161.05   | 464,281,903.58   |
| 应付证券清算款       | 3,921,668.48     | -                |
| 应付赎回款         | 29,897.57        | 104,360.26       |
| 应付管理人报酬       | 533,746.46       | 3,020,074.21     |
| 应付托管费         | 177,915.50       | 862,878.33       |
| 应付销售服务费       | 24,033.32        | 438,722.32       |
| 应付交易费用        | 86,296.53        | 60,778.94        |
| 应交税费          | -                | -                |
| 应付利息          | 322,759.59       | 203,368.66       |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 278,519.17       | 360,000.27       |
| 负债合计          | 635,672,997.67   | 469,332,086.57   |
| <b>所有者权益：</b> | -                | -                |
| 实收基金          | 1,950,820,118.00 | 4,776,299,153.45 |
| 未分配利润         | 82,584,861.26    | 148,086,128.06   |
| 所有者权益合计       | 2,033,404,979.26 | 4,924,385,281.51 |
| 负债和所有者权益总计    | 2,669,077,976.93 | 5,393,717,368.08 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 1.042 元，B 类份额净值 1.042 元，基金份额总额 1,950,820,118.00 份，其中 A 类基金份额 38,387,566.84 份；B 类基金份额 1,912,432,551.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>      | <b>55,354,937.70</b>                     | <b>13,848,383.74</b>                          |
| 1.利息收入           | 99,695,504.01                            | 17,812,457.41                                 |
| 其中：存款利息收入        | 326,256.08                               | 84,251.03                                     |
| 债券利息收入           | 98,652,074.56                            | 17,721,051.00                                 |
| 资产支持证券利息收入       | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入       | 717,173.37                               | 7,155.38                                      |
| 其他利息收入           | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -82,870,883.19                           | 1,173,970.60                                  |

|                            |                      |                     |
|----------------------------|----------------------|---------------------|
| 其中：股票投资收益                  | -                    | -                   |
| 基金投资收益                     | -                    | -                   |
| 债券投资收益                     | -82,870,883.19       | 1,173,970.60        |
| 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                       | -                    | -                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 38,529,269.73        | -5,169,335.12       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                    | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 1,047.15             | 31,290.85           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>28,320,219.18</b> | <b>4,475,743.48</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 13,204,269.37        | 2,011,171.42        |
| 2. 托管费                     | 3,823,941.81         | 574,620.39          |
| 3. 销售服务费                   | 832,991.85           | 310,127.84          |
| 4. 交易费用                    | 62,026.53            | 10,981.97           |
| 5. 利息支出                    | 10,110,191.05        | 1,332,587.98        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 10,110,191.05        | 1,332,587.98        |
| 6. 其他费用                    | 286,798.57           | 236,253.88          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>27,034,718.52</b> | <b>9,372,640.26</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>27,034,718.52</b> | <b>9,372,640.26</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>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）                   | 4,776,299,153.45                      | 148,086,128.06 | 4,924,385,281.51  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | 27,034,718.52  | 27,034,718.52     |
| 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） | -2,825,479,035.45                     | -59,047,768.94 | -2,884,526,804.39 |
| 其中：1.基金申购款                        | 234,116,565.86                        | 7,446,135.15   | 241,562,701.01    |

|  |                      |                |                   |
|--|----------------------|----------------|-------------------|
| 2.基金赎回款                                | -3,059,595,601.31    | -66,493,904.09 | -3,126,089,505.40 |
| 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） | -                    | -33,488,216.38 | -33,488,216.38    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,950,820,118.00     | 82,584,861.26  | 2,033,404,979.26  |
| 项目                                     | 上年度可比期间              |                |                   |
|  | 2016年1月1日至2016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）                        | 605,709,228.77       | 42,345,110.00  | 648,054,338.77    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                    | 9,372,640.26   | 9,372,640.26      |
| 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）      | -176,942,307.53      | -9,229,400.81  | -186,171,708.34   |
| 其中：1.基金申购款                             | 692,257,403.99       | 38,018,614.02  | 730,276,018.01    |
| 2.基金赎回款                                | -869,199,711.52      | -47,248,014.83 | -916,447,726.35   |
| 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） | -                    | -18,695,317.76 | -18,695,317.76    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 428,766,921.24       | 23,793,031.69  | 452,559,952.93    |

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：

基金管理人负责人：王彬，主管会计工作负责人：王彬，会计机构负责人：冯伟

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国投瑞银纯债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[2012]1369号文《关于同意国投瑞银纯债债券型证券投资基金募集的批复》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2012年12月11日正式生效，首次设立募集规模为2,581,013,648.59份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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国债、央行票据、信用债（即企业债、公司债、可分离债存债、次级债、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、金融债、中小企业私募债券等非国家信用的固定收益类金融工具）、债券回购、银行存款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。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的 80%；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%。

本基金不参与可转债（不含可分离债存债）投资、不参与股票一级市场投资，也不进行二级市场股票、权证投资。

本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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。

根据《国投瑞银基金管理有限公司关于调低国投瑞银纯债债券型证券投资基金 B 类基金份额销售服务费率的公告》，本基金 B 类基金份额的销售服务费自 2017 年 2 月 17 日起实施调整后的销售服务费率 0.01%/年。

根据《关于国投瑞银纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2017 年 5 月 8 日起实施调整后的基金管理费率 0.30%/年，基金托管费率 0.10%/年。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 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会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持



有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

证券投资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，股权的股息、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) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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

本报告期内，本基金新增与基金管理人受同一实际控制的关联方安信证券股份有限公司。

### 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、注册登记机构、基金销售机构     |
| 中国银行股份有限公司("中国银行") | 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、基金销售机构 |

注：以下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 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月<br>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 |
| 安信证券  | 19,134,790.42              | 2.06%        | -                                   | -            |

注：安信证券股份有限公司为本基金本报告期新增的关联方，不涉及上年度可比期间数据。

##### 6.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 |                |
|-------|----------------------------|----------------|-------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                                | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 安信证券  | 80,000,000.00              | 6.22%          | -                                   | -              |

注：安信证券股份有限公司为本基金本报告期新增的关联方，不涉及上年度可比

期间数据。

## 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<br>2017年1月1日至2017年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 13,204,269.37                  | 2,011,171.42                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | 24,869.23                      | 18,707.02                           |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提。根据《关于国投瑞银纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2017 年 5 月 8 日表决通过了《关于调整国投瑞银纯债债券型证券投资基金管理费率、托管费率相关事项的议案》，基金管理人的管理费率由 0.70% 调整为 0.30%，自表决通过之日起生效。计算方法如下：

$$H=E \times \text{管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年1月1日至2017年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,823,941.81                   | 574,620.39                          |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提。根据《关于国投瑞银纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2017 年 5 月 8 日表决通过了《关于调整国投瑞银纯债债券型证券投资基金管理费率、托管费率相关事项的议案》，托管费率由 0.20% 调整为 0.10%，自表决通过之日起生效。计算方法如下：

$$H=E \times \text{托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

### 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<br>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                |            |            |
|                | 国投瑞银纯债债券 A                      | 国投瑞银纯债债券 B | 合计         |
| 中国银行           | 2,646.01                        | -          | 2,646.01   |
| 国投瑞银基金管理有限公司   | 14,056.66                       | 791,390.05 | 805,446.71 |
| 安信证券           | 29.13                           | -          | 29.13      |
| 合计             | 16,731.80                       | 791,390.05 | 808,121.85 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 国投瑞银纯债债券 A                      | 国投瑞银纯债债券 B | 合计         |
| 中国银行           | 5,237.24                        | 273.22     | 5,510.46   |
| 国投瑞银基金管理有限公司   | 17,900.48                       | 274,724.40 | 292,624.88 |
| 合计             | 23,137.72                       | 274,997.62 | 298,135.34 |

注：1、基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金 A 类基金份额按前一日 A 类资产净值的 0.3% 的年费率逐日计提；B 类基金份额按前一日 B 类资产净值的 0.1% 的年费率逐日计提，根据《国投瑞银基金管理有限公司关于调低国投瑞银纯债债券型证券投资基金 B 类基金份额销售服务费率的公告》，本基金 B 类基金份额的销售服务费自 2017 年 2 月 17 日起实施调整后的销售服务费率 0.01%/年。各类基金份额的销售服务费计提计算公式如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日各类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日各类基金份额的资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基

金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、安信证券股份有限公司为本基金本报告期新增的关联方，不涉及上年度可比期间数据。

### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日      |               |                   |       |          |                   |               |
|---------------------------------|---------------|-------------------|-------|----------|-------------------|---------------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称          | 债券交易金额        |                   | 基金逆回购 |          | 基金正回购             |               |
|                                 | 基金买入          | 基金卖出              | 交易金额  | 利息收<br>入 | 交易金额              | 利息支<br>出      |
| 中国银行                            | 49,617,050.00 | 40,200,68<br>0.00 | -     | -        | -                 | -             |
| 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |               |                   |       |          |                   |               |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称          | 债券交易金额        |                   | 基金逆回购 |          | 基金正回购             |               |
|                                 | 基金买入          | 基金卖出              | 交易金额  | 利息收<br>入 | 交易金额              | 利息支<br>出      |
| 中国银行                            | -             | -                 | -     | -        | 44,100,000.0<br>0 | 20,298.0<br>8 |

### 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

本报告期及上年度可比期间本基金基金管理人均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

本报告期末及上年度末除本基金基金管理人之外的其他关联方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 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
|-------|----|---------|

|      | 2017年1月1日至2017年6月<br>30日 |            | 2016年1月1日至2016年6月<br>30日 |           |
|------|--------------------------|------------|--------------------------|-----------|
|      | 期末余额                     | 当期利息收入     | 期末余额                     | 当期利息收入    |
| 中国银行 | 16,138,634.<br>82        | 252,823.35 | 44,594,498.<br>12        | 48,427.80 |

#### 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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 6.4.9 期末（2017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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有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

截至本期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金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人民币 559,298,161.05 元，是以如下债券作为质押：

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<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值总额        |
|-----------|-------------------|------------|------------|------------|---------------|
| 101573017 | 15 蚌埠城投<br>MTN001 | 2017-07-03 | 99.93      | 700,000.00 | 69,951,000.00 |
| 101480004 | 14 鞍山城建<br>MTN003 | 2017-07-04 | 99.63      | 700,000.00 | 69,741,000.00 |
| 101761003 | 17 张保实业<br>MTN001 | 2017-07-04 | 99.09      | 700,000.00 | 69,363,000.00 |
| 140446    | 14 农发 46          | 2017-07-04 | 100.24     | 600,000.00 | 60,144,000.00 |
| 101759005 | 17 浏阳水利<br>MTN001 | 2017-07-03 | 98.76      | 600,000.00 | 59,256,000.00 |
| 101754025 | 17 苏州高新           | 2017-07-04 | 99.67      | 500,000.00 | 49,835,000.00 |

|           |                   |            |        |              |                |
|-----------|-------------------|------------|--------|--------------|----------------|
|           | MTN001            |            |        |              |                |
| 101759004 | 17 常州投资<br>MTN001 | 2017-07-04 | 100.32 | 400,000.00   | 40,128,000.00  |
| 170401    | 17 农发 01          | 2017-07-04 | 99.62  | 400,000.00   | 39,848,000.00  |
| 101658035 | 16 烟台打捞<br>MTN001 | 2017-07-03 | 98.14  | 300,000.00   | 29,442,000.00  |
| 101656050 | 16 新中泰<br>MTN002  | 2017-07-03 | 97.44  | 300,000.00   | 29,232,000.00  |
| 101459029 | 14 常熟经营<br>MTN001 | 2017-07-04 | 104.64 | 200,000.00   | 20,928,000.00  |
| 101461032 | 14 太湖新发<br>MTN001 | 2017-07-04 | 102.04 | 200,000.00   | 20,408,000.00  |
| 011698758 | 16 新华医疗<br>SCP001 | 2017-07-03 | 100.23 | 200,000.00   | 20,046,000.00  |
| 101662040 | 16 鄞州城建<br>MTN002 | 2017-07-04 | 99.79  | 100,000.00   | 9,979,000.00   |
| 合计        |                   |            |        | 5,900,000.00 | 588,301,000.00 |

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 71,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本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

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   | -                | -             |
|    | 其中：股票  | -                | -             |
| 2  | 固定收益投资 | 2,597,466,232.67 | 97.32         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 2,597,466,232.67 | 97.32  |
|   | 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          | -                | -      |
|   | 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      | 19,789,312.38    | 0.74   |
| 7 | 其他各项资产            | 51,822,431.88    | 1.94   |
| 8 | 合计                | 2,669,077,976.93 | 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 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末进行股票投资。

## 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      | 1,760,800.00     | 0.09         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 217,040,000.00   | 10.67        |
|    | 其中：政策性金融债 | 217,040,000.00   | 10.67        |
| 4  | 企业债券      | 994,499,432.67   | 48.91        |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,112,000.00    | 2.46         |
| 6  | 中期票据      | 1,334,054,000.00 | 65.61        |



|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 2,597,466,232.67 | 127.74 |

### 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  | 101761015 | 17 宜华企业 MTN001 | 900,000 | 90,558,000.00 | 4.45         |
| 2  | 101754009 | 17 淮安开发 MTN001 | 900,000 | 89,505,000.00 | 4.40         |
| 3  | 170401    | 17 农发 01       | 800,000 | 79,696,000.00 | 3.92         |
| 4  | 170405    | 17 农发 05       | 800,000 | 77,200,000.00 | 3.80         |
| 5  | 101573017 | 15 蚌埠城投 MTN001 | 700,000 | 69,951,000.00 | 3.44         |

### 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 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

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 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   | 71,159.24     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 51,570,457.36 |
| 5  | 应收申购款   | 169,565.28    |
| 6  | 其他应收款   | 11,250.00     |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 51,822,431.88 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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 | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|------|----|--------|-------|
|------|----|--------|-------|

|            | 人户数<br>(户) | 金份额            | 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 |
| 国投瑞银纯债债券 A | 6,104      | 6,288.92       | 18,757,990.24    | 48.86%  | 19,629,576.60 | 51.14% |
| 国投瑞银纯债债券 B | 8          | 239,054,068.90 | 1,912,432,551.16 | 100.00% | -             | 0.00%  |
| 合计         | 6,112      | 319,178.68     | 1,931,190,541.40 | 98.99%  | 19,629,576.60 | 1.01%  |

### 8.2 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 | 国投瑞银纯债债券 A | 859,153.74 | 2.24%    |
|                  | 国投瑞银纯债债券 B | 0.00       | 0.00%    |
|                  | 合计         | 859,153.74 | 0.04%    |

### 8.3 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                           | 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 国投瑞银纯债债券 A | 0~10              |
|                              | 国投瑞银纯债债券 B | 0                 |
|                              | 合计         | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 国投瑞银纯债债券 A | 10~50             |
|                              | 国投瑞银纯债债券 B | 0                 |
|                              | 合计         | 10~50             |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国投瑞银纯债债券 A | 国投瑞银纯债债券 B |
|----|------------|------------|
|----|------------|------------|

|                                 |                  |                  |
|---------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 12 月 11 日）基金份额总额 | 1,623,793,743.60 | 957,219,904.99   |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 34,246,919.03    | 4,742,052,234.42 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 25,449,116.39    | 208,667,449.47   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 21,308,468.58    | 3,038,287,132.73 |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 38,387,566.84    | 1,912,432,551.16 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式于 2017 年 4 月 5 日起至 2017 年 5 月 5 日止召开基金份额持有人大会，并于 2017 年 5 月 8 日进行本次持有人大会的计票工作，会议审议通过了《关于调整国投瑞银纯债债券型证券投资基金管理费率、托管费率相关事项的议案》，相关决议自 2017 年 5 月 8 日起生效。自 2017 年 5 月 8 日起，基金管理人对本基金实施调整后的管理费率 and 托管费率，详情请见本次基金持有人大会的相关公告及更新后的《国投瑞银纯债债券型证券投资基金基金合同》。

### 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

报告期内基金投资策略未发生变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 回购交易 |
|------|------|------|
|------|------|------|

|      | 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 |
|------|----------------|--------------|----------------|--------------|
| 中金公司 | 324,816,091.53 | 34.93%       | 15,000,000.00  | 1.17%        |
| 兴业证券 | 200,614,758.94 | 21.58%       | 106,000,000.00 | 8.24%        |
| 中信证券 | 190,325,280.58 | 20.47%       | 383,000,000.00 | 29.78%       |
| 中信建投 | 142,565,853.50 | 15.33%       | 141,000,000.00 | 10.96%       |
| 招商证券 | 24,838,858.27  | 2.67%        | 309,000,000.00 | 24.02%       |
| 安信证券 | 19,134,790.42  | 2.06%        | 80,000,000.00  | 6.22%        |
| 国信证券 | 10,987,939.83  | 1.18%        | -              | -            |
| 东北证券 | 10,851,192.12  | 1.17%        | 117,000,000.00 | 9.10%        |
| 长江证券 | 4,430,463.80   | 0.48%        | -              | -            |
| 银河证券 | 1,073,066.71   | 0.12%        | 94,000,000.00  | 7.31%        |
| 第一创业 | 183,499.26     | 0.02%        | -              | -            |
| 华安证券 | -              | -            | 41,243,000.00  | 3.21%        |

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、本报告期内未发生交易所股票和权证交易。

3、本报告期本基金新增租用天风证券、中信建投及兴业证券各 1 个交易单元。

## 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   | 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              | 20170101-20170630       | 4,708,097,928.44 | -    | 2,946,000,000.00 | 1,762,097,928.44 | 90.33% |
| 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：<br>1、赎回申请延期办理的风险<br>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。<br>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间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、基金财产清算（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

二〇一七年八月二十五日