

中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证 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：中银国际证券有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 25 日起至 2017 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	中银国际证券有限责任公司	
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	635,243,530.39 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	613,712,711.19 份	21,530,819.20 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、中小企业私募债券投资策略、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		中银国际证券有限责任公司	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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-61195566, 400-620-8888	95533
传真		021-50372474	010-66275830

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(2017年1月25日-2017年6月30日)	报告期(2017年1月25日-2017年6月30日)
本期已实现收益	22,386,647.06	737,834.99
本期利润	21,691,146.34	713,411.99
加权平均基金份额本期利润	0.0353	0.0331
本期基金份额净值增长率	3.53%	3.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0353	0.0331
期末基金资产净值	635,403,857.53	22,244,231.19
期末基金份额净值	1.0353	1.0331

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	1.46%	0.11%	2.53%	0.27%	-1.07%	-0.16%
过去三个月	2.32%	0.14%	1.88%	0.27%	0.44%	-0.13%

自基金合同生效起至今	3.53%	0.14%	2.45%	0.25%	1.08%	-0.11%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

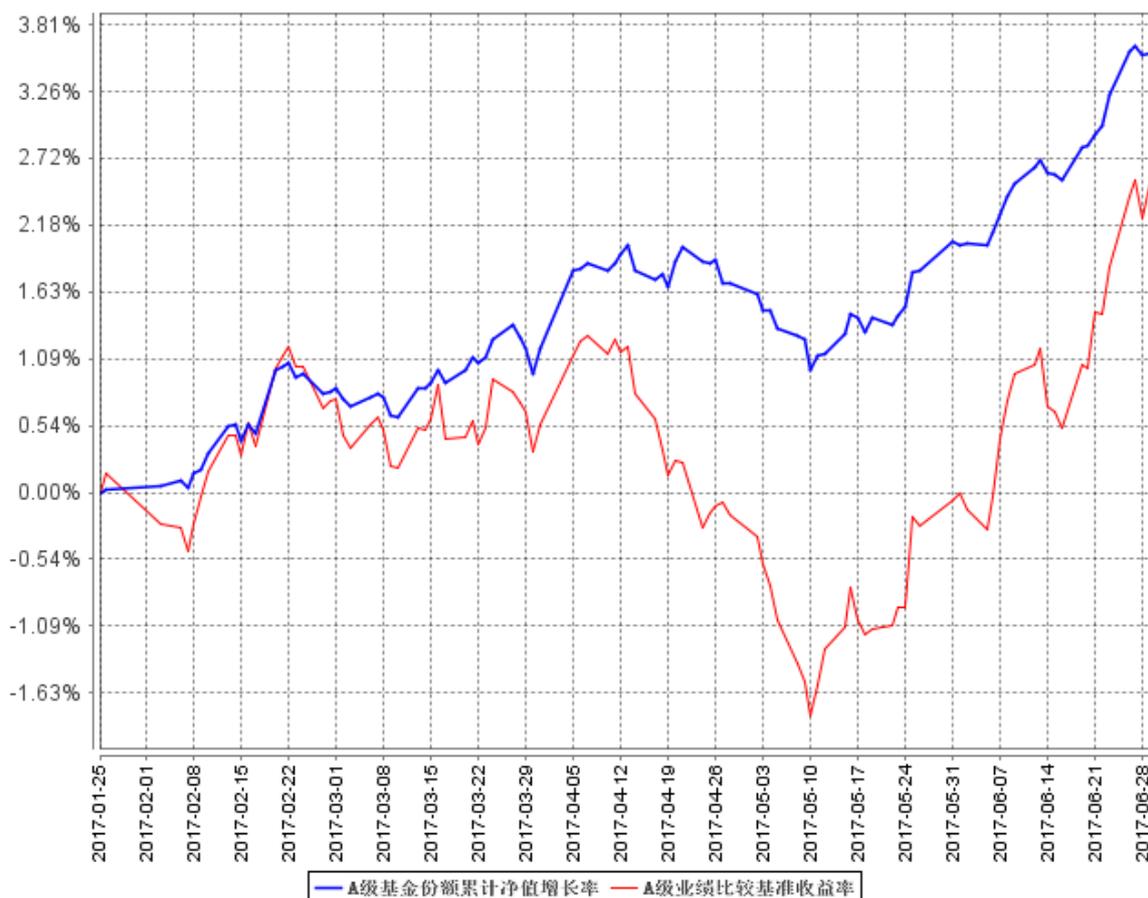
中银证券瑞益混合 C

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	1.42%	0.11%	2.53%	0.27%	-1.11%	-0.16%
过去三个月	2.20%	0.14%	1.88%	0.27%	0.32%	-0.13%
自基金合同生效起至今	3.31%	0.14%	2.45%	0.25%	0.86%	-0.11%

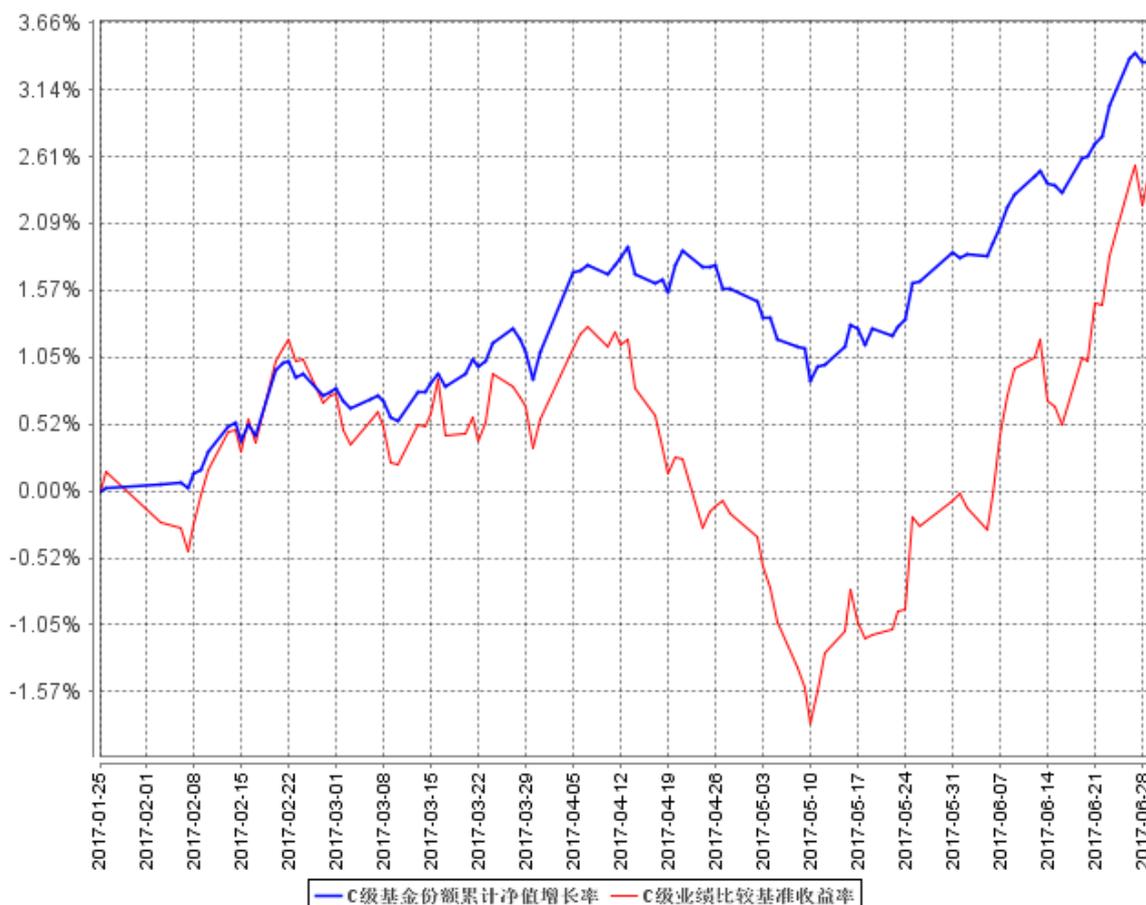
注：本基金成立于 2017 年 01 月 25 日，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+中债综合全价指数收益率×60%。

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

A 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2017 年 1 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合基金合同投资范围、投资限制中规定的各项比例：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。

§ 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

中银国际证券有限责任公司(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。中银国际证券由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、上海联新投资中心（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共同投资。

中银国际证券的经营经营范围包括：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 2017 年 6 月 30 日，本管理人共管理六只开放式证券投资基金，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和中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

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	本基金经理	2017 年 1 月 26 日	-	10	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有限责任公司，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。2017 年 1 月起担任中银证券保本 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基金经理、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
吴亮谷	本基金经理	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

					<p>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有限责任公司，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基金经理、中银证券现金管家货币市场基金基金经理、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经理、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
罗众球	本基金 经理	2017 年 1 月 25 日	-	7	<p>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 月任职于宏源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有限责任公司，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基金经理、中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金经理、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经理、</p>

					中银证券瑞享定期开放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》、《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》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《中银国际证券有限责任公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法》、《中银国际证券有限责任公司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。公司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。

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，公司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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2017 年以来，受国内 3 月份经济增长数据显著超预期、金融监管政策收紧、货币政策紧缩预期等多方面因素影响，债券市场 4、5 月份持续调整。资金面继续维持紧平衡格局，由于市场预期半年末 MPA 考核会导致资金面紧张局面持续，长期限资金价格居高不下；监管方面，银监会密集发文，对银行“三违反”、“三套利”、“四不当”行为进行专项治理，要求银行提交自查报告。伴随多个银行赎回委外资金的传言，债券市场持续调整，收益率大幅上行。5 月 12 日，银监会称“绝不因为处置风险而引发新的风险”，央行当日释放 4590 亿元的 MLF 呵护市场，在《2017 年第 1 季度货币政策执行报告》央行提出：“加强金融监管协调，有机衔接监管政策出台的时机和节奏，稳定市场预期，把握好去杠杆和维护流动性基本稳定的平衡”，标志着监管态度的转变。在 5 月 25 日的自律机制座谈会上，央行提前释放 6 月份续作 MLF 的消息，稳定市场信心。6 月份以来，在央行提出监管协调和资金面宽松的共同推动下，债券市场开始震荡下行。

权益方面，4 月初股指受到雄安新区的利好刺激短暂冲高，随后由于金融防风险、去杠杆和银行、保险自查等原因市场出现了快速回落。5 月中旬开始央行操作缓解了市场对于流动性的担忧，随后在 IPO 节奏放缓和减持新规等政策的支持下 A 股逐渐起稳。进入 6 月市场在经历了美联储加息的短暂冲击和 A 股成功纳入 MSCI 的利好刺激后持续震荡回升。

整体来看，二季度曲线继续变平，利率先上后下，收益率整体上行，10 年期国债较 3 月末上行约 23BP，10 年期国开债较 3 月末上行约 9BP。股票市场上，在控制仓位的前提下，增加低估值高股息的蓝筹股的配置。

策略方面，在债券市场去杠杆的背景下，货币市场资金阶段性紧张，资金价格中枢上抬。在资金紧张时期，组合保持低久期，增加了逆回购的配置比例，分享资金紧张带来的高融资收益。在利率债充分调整后，增加了对中长期利率债的波段操作，同时增加了对可转换债券的投资，取得了较好的收益。积极参与新股和可转换债券的申购。

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 1.0353 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.53%；截至本报告期末中银证券瑞益混合 C 基金份额净值为 1.0331 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.31%；同期业绩比较基准收益率为 2.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，重点关注海外缩表预期和国内监管政策的变化对债券市场的影响。十九大召开在即，预计监管政策在三季度难有更严厉的措施出台，这或将为债券市场提供投资良机，但7月初受缴税和银行分红等因素影响，资金面可能较半年末有所紧张，但经历过第二季度的剧烈调整后，央行料将维持稳健的货币政策，关注资金短期紧张对市场的影响。展望未来，上半年经济周期高点已过，但预计下降的幅度较为缓和，经济增速短期大概率不会跌到政策底线之下。多空因素交织，利率债料将继续区间震荡；信用债将迎来信用利差分化的局面，高等级信用债收益率受配置需求推动，或将继续高位回落。低等级信用债在部分委外机构赎回的压力下，收益率料将继续维持高位。

股票市场上，市场有望迎来调整后情绪和基本面向上修复的投资机会。总体预计还是以震荡格局为主，投资者情绪有望恢复。市场稳定可期。标的选择上继续增加低估值有业绩的行业龙头。

综合上述判断，三季度组合将继续在稳健安全、追求绝对收益的前提下开展。具体而言，择机配置高等级信用债，谨慎配置中低评级券种以防范信用风险，继续加大利率债波段操作频次，适时参与转债市场。

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关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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	2,176,979.48	-
结算备付金	463,742.38	-
存出保证金	45,760.04	-
交易性金融资产	502,197,654.85	-
其中：股票投资	130,805,172.45	-
基金投资	-	-
债券投资	371,392,482.40	-
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	276,301,204.67	-
应收证券清算款	7,492,037.26	-
应收利息	5,414,051.69	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	794,091,430.37	-
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 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	127,499,300.00	-
应付证券清算款	8,223,200.34	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	321,639.03	-
应付托管费	53,606.52	-
应付销售服务费	46,607.83	-
应付交易费用	98,493.15	-
应交税费	-	-

应付利息	32,441.98	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	168,052.80	-
负债合计	136,443,341.65	-
所有者权益：		
实收基金	635,243,530.39	-
未分配利润	22,404,558.33	-
所有者权益合计	657,648,088.72	-
负债和所有者权益总计	794,091,430.37	-

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，中银证券瑞益混合 A 基金份额净值 1.0353 元，基金份额总额 613,712,711.19 份；中银证券瑞益混合 C 基金份额净值 1.0331 元，基金份额总额 21,530,819.20 份。中银证券瑞益混合份额总额合计为 635,243,530.39 份；

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日。

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：2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	25,562,260.79	-
1.利息收入	9,512,019.34	-
其中：存款利息收入	211,645.77	-
债券利息收入	5,315,921.14	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,984,452.43	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	16,731,062.48	-
其中：股票投资收益	16,197,543.21	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-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	1,340,893.30	-
3.公允价值变动收益（损失以	-719,923.72	-

“-”号填列)		
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	3,157,702.46	-
1. 管理人报酬	1,651,835.34	-
2. 托管费	275,305.92	-
3. 销售服务费	46,607.83	-
4. 交易费用	525,121.59	-
5. 利息支出	473,759.98	-
其中: 卖出回购金融资产支出	473,759.98	-
6. 其他费用	185,071.80	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	22,404,558.33	-
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	22,404,558.33	-

注: 本基金合同于 2017 年 1 月 25 日生效, 本报告期自 2017 年 1 月 25 日至 2017 年 6 月 30 日。

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: 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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)	-	-	-
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)	635,243,530.39	-	635,243,530.39
其中: 1.基金申购款	635,243,530.39	-	635,243,530.39
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
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）	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金合同于 2017 年 1 月 25 日生效，本报告期自 2017 年 1 月 25 日至 2017 年 6 月 30 日。

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

基金管理人负责人

赵向雷

主管会计工作负责人

戴景义

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]2728号《关于核准中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由中银国际证券有限责任公司依照《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。本基金为契约型证券投资基金，首次设立募集包括认购资金利息共募集 635,243,530.39 元，已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 01 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额(包括认购资金利息折算部分)为 635,243,530.39 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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）。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券有限责任公司于 2017 年 8 月 29 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》、《中银证券瑞益定期开放灵活配置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 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

自基金合同成立以来, 未进行会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

自基金合同成立以来, 未进行会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

自基金合同成立以来, 不存在需要说明的差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。对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, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额, 依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税, 暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从公开发

行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。

(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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 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
中银国际证券有限责任公司	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	基金管理人的控股股东、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。

6.4.7 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。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月25日(基金合同生效日) 至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中银国际	437,309,475.74	100.00%	-	-

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月25日(基金合同生效日) 至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中银国际	27,735,929.60	100.00%	-	-

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至 2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中银国际	6,003,600,000.00	100.00%	-	-

6.4.7.1.4 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。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中银国际	319,803.12	100.00%	83,997.68	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,651,835.34	-
其中：支付销售机构的客户维护费	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：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.7.2.3 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		
	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
中银国际	-	37,247.65	37,247.65
中国银行	-	9,360.18	9,360.18
合计	-	46,607.83	46,607.83

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	中银证券瑞益混合 A	中银证券瑞益混合 C	合计
-	-	-	-

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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）的交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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 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	20,000,000.00	-
期初持有的基金份额	20,000,000.00	-
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	-	-
期末持有的基金份额	20,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.2600%	-

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	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。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 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。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估值 单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
002879	长缆科	2017 年	2017 年	新股流通	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.2	-

	技	6月5日	7月7日	受限						6
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	0
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	6
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	7
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	6
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	7
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	2
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	6

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 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
600795	国电电力	2017年6月5日	重大资产重组	3.60	-	-	2,951,200	9,561,888.00	10,624,320.00	-
000100	TCL集团	2017年6月2日	重大事项	3.43	-	-	1,841,212	6,456,551.41	6,315,357.16	-
601989	中国重工	2017年5月	重大资产	6.21	-	-	814,200	6,358,902.00	5,056,182.00	-

		31 日	重组						
--	--	------	----	--	--	--	--	--	--

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 119,999,300 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	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111793043	17 上海农商银行 CD065	2017 年 7 月 5 日	97.81	300,000	29,343,000.00
111793320	17 龙江银行 CD066	2017 年 7 月 4 日	97.73	300,000	29,319,000.00
111791892	17 苏州银行 CD020	2017 年 7 月 5 日	97.80	250,000	24,450,000.00
011760041	17 广汇汽车 SCP006	2017 年 7 月 4 日	99.77	200,000	19,954,000.00
111793243	17 温州银行 CD048	2017 年 7 月 5 日	95.44	200,000	19,088,000.00
合计				1,250,000	122,154,000.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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 7,500,000.00 元，于 2017 年 7 月 28 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。

6.4.9 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 2017 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 502,197,654.85 元，无属于第二层次及第三层次的余额。

(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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2017 年 1 月 25 日成立以来一直采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 2017 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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(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	130,805,172.45	16.47
	其中：股票	130,805,172.45	16.47
2	固定收益投资	371,392,482.40	46.77
	其中：债券	371,392,482.40	46.77
	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	276,301,204.67	34.79
	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	2,640,721.86	0.33
7	其他各项资产	12,951,848.99	1.63
8	合计	794,091,430.37	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	59,691,975.98	9.08

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,624,320.00	1.62
E	建筑业	12,294,591.00	1.87
F	批发和零售业	3,145,869.00	0.48
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	7,639.62	0.00
J	金融业	29,255,226.00	4.45
K	房地产业	15,785,550.85	2.40
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	130,805,172.45	19.89

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	600048	保利地产	1,583,305	15,785,550.85	2.40
2	002202	金风科技	777,564	12,028,915.08	1.83
3	600795	国电电力	2,951,200	10,624,320.00	1.62
4	002081	金螳螂	939,350	10,314,063.00	1.57

5	000860	顺鑫农业	494,300	9,890,943.00	1.50
6	000001	平安银行	1,033,000	9,699,870.00	1.47
7	000625	长安汽车	604,300	8,714,006.00	1.33
8	600688	上海石化	1,181,800	7,811,698.00	1.19
9	600030	中信证券	389,600	6,630,992.00	1.01
10	601998	中信银行	1,053,600	6,627,144.00	1.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601006	大秦铁路	19,170,183.78	2.91
2	600048	保利地产	14,803,354.25	2.25
3	002202	金风科技	12,881,560.76	1.96
4	600612	老凤祥	12,850,952.12	1.95
5	000402	金融街	12,748,207.38	1.94
6	002081	金螳螂	10,630,166.16	1.62
7	000860	顺鑫农业	9,860,813.00	1.50
8	600085	同仁堂	9,588,656.68	1.46
9	000001	平安银行	9,564,960.00	1.45
10	600795	国电电力	9,561,888.00	1.45
11	000100	TCL 集团	9,560,978.00	1.45
12	002422	科伦药业	9,559,673.00	1.45
13	000625	长安汽车	8,449,540.00	1.28
14	600688	上海石化	7,823,516.00	1.19
15	601998	中信银行	6,480,276.00	0.99
16	002206	海利得	6,453,815.94	0.98
17	600376	首开股份	6,415,640.25	0.98
18	600428	中远海特	6,365,269.25	0.97
19	600886	国投电力	6,360,848.00	0.97
20	601989	中国重工	6,358,902.00	0.97

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601006	大秦铁路	21,831,642.91	3.32
2	600612	老凤祥	14,805,655.40	2.25
3	000402	金融街	14,268,677.90	2.17
4	600085	同仁堂	10,545,115.50	1.60
5	002422	科伦药业	9,426,560.00	1.43
6	000423	东阿阿胶	7,459,689.00	1.13
7	000858	五粮液	7,145,547.53	1.09
8	600428	中远海特	7,037,355.00	1.07
9	000651	格力电器	7,005,377.00	1.07
10	600886	国投电力	6,988,624.00	1.06
11	600376	首开股份	6,956,752.92	1.06
12	600089	特变电工	6,933,824.00	1.05
13	000895	双汇发展	6,758,643.00	1.03
14	000999	华润三九	6,739,997.00	1.02
15	601398	工商银行	6,553,210.00	1.00
16	002007	华兰生物	6,361,425.00	0.97
17	600900	长江电力	3,222,828.00	0.49
18	000100	TCL 集团	3,213,595.44	0.49
19	600887	伊利股份	2,118,625.00	0.32
20	000063	中兴通讯	1,951,634.00	0.30

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	277,423,400.55
卖出股票收入（成交）总额	162,026,385.30

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	37,982,702.40	5.78
2	央行票据	-	-

3	金融债券	38,695,000.00	5.88
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	49,898,000.00	7.59
5	企业短期融资券	20,036,000.00	3.05
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,214,780.00	1.40
8	同业存单	215,566,000.00	32.78
9	其他	-	-
10	合计	371,392,482.40	56.47

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	111797479	17 金华银行 CD029	300,000	29,646,000.00	4.51
2	111797412	17 威海农商银 行 CD021	300,000	29,643,000.00	4.51
3	111797923	17 石嘴山银行 CD063	300,000	29,643,000.00	4.51
4	170210	17 国开 10	300,000	29,625,000.00	4.50
5	111793043	17 上海农商银 行 CD065	300,000	29,343,000.00	4.46

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

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。

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。

报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	45,760.04
2	应收证券清算款	7,492,037.26
3	应收股利	-
4	应收利息	5,414,051.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,951,848.99

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	113008	电气转债	1,557,900.00	0.24
2	123001	蓝标转债	524,050.00	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600795	国电电力	10,624,320.00	1.62	重大资产重组

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
中银证券瑞益混合 A	2,960	207,335.38	332,475,802.14	54.17%	281,236,909.05	45.83%
中银证券瑞益混合 C	339	63,512.74	1,000,534.72	4.65%	20,530,284.48	95.35%
合计	3,299	270,848.12	333,476,336.86	58.82%	301,767,193.53	141.18%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无

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：无

§ 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	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	613,712,711.19	21,530,819.20

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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本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

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
中银国际	2	437,309,475.74	100.00%	319,803.12	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	27,735,929.60	100.00%	6,003,600,000.00	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	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	2017 年 04 月 01 日至 2017 年 6 月 30 日	299,999,000.00	-	-	299,999,000.00	47.23
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在大额赎回甚至是巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，加强对投资者利益的保护。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中银国际证券有限责任公司
2017 年 8 月 29 日