

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

2017 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

1 重要提示及目录

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 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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
8 基金份额持有人信息	45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	46
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银优化增强债券型证券投资基金	
基金简称	国投瑞银优化增强债券	
基金主代码	121012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 9 月 8 日	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,349,690,968.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银优化增强债券 A/B	国投瑞银优化增强债券 C
下属分级基金的交易代码	121012	128112
报告期末下属分级基金的份额总额	925,828,526.24 份	423,862,442.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>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债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。</p> <p>本基金既可以参与一级市场新股申购或增发新股，也可以在二级市场买入股票、权证等权益类资产。</p> <p>本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中权证投资的比例不超过基金资产净值的 3%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，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	中国建设银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	刘凯	田青
	联系电话	400-880-6868	010-67595096
	电子邮箱	service@ubssdic.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	400-880-6868	010-67595096	
传真	0755-82904048	010-66275853	
注册地址	上海市虹口区东大名路638号7层	北京市西城区金融大街25号	
办公地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
邮政编码	518035	100033	
法定代表人	叶柏寿	王洪章	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	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）	
	国投瑞银优化增强债券 A/B	国投瑞银优化增强债券 C
本期已实现收益	28,627,096.31	23,380,487.97

本期利润	36,444,611.34	29,416,987.64
加权平均基金份额本期利润	0.0417	0.0391
本期加权平均净值利润率	2.95%	2.81%
本期基金份额净值增长率	3.17%	3.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	国投瑞银优化增强债券 A/B	国投瑞银优化增强债券 C
期末可供分配利润	201,587,720.81	90,392,239.86
期末可供分配基金份额利润	0.2177	0.2133
期末基金资产净值	1,214,844,196.97	554,611,244.68
期末基金份额净值	1.312	1.308
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	国投瑞银优化增强债券 A/B	国投瑞银优化增强债券 C
基金份额累计净值增长率	67.57%	63.13%

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

国投瑞银优化增强债券 A/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	1.78%	0.12%	1.28%	0.11%	0.50%	0.01%
过去三个月	1.78%	0.14%	-0.34%	0.13%	2.12%	0.01%
过去六个月	3.17%	0.14%	-1.21%	0.12%	4.38%	0.02%
过去一年	4.85%	0.18%	-1.92%	0.15%	6.77%	0.03%
过去三年	49.35%	0.37%	9.54%	0.21%	39.81%	0.16%
自基金合同生效起至今	67.57%	0.31%	4.25%	0.19%	63.32%	0.12%

国投瑞银优化增强债券 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	1.79%	0.12%	1.28%	0.11%	0.51%	0.01%
过去三个月	1.95%	0.14%	-0.34%	0.13%	2.29%	0.01%
过去六个月	3.13%	0.13%	-1.21%	0.12%	4.34%	0.01%
过去一年	4.62%	0.18%	-1.92%	0.15%	6.54%	0.03%
过去三年	47.70%	0.38%	9.54%	0.21%	38.16%	0.17%
自基金合同 生效起至今	63.13%	0.31%	4.25%	0.19%	58.88%	0.12%

注：1、中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。沪深 300 指数是由中证指数公司开发的中国 A 股市场统一指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势，具有权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准，具体业绩比较基准为中债总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

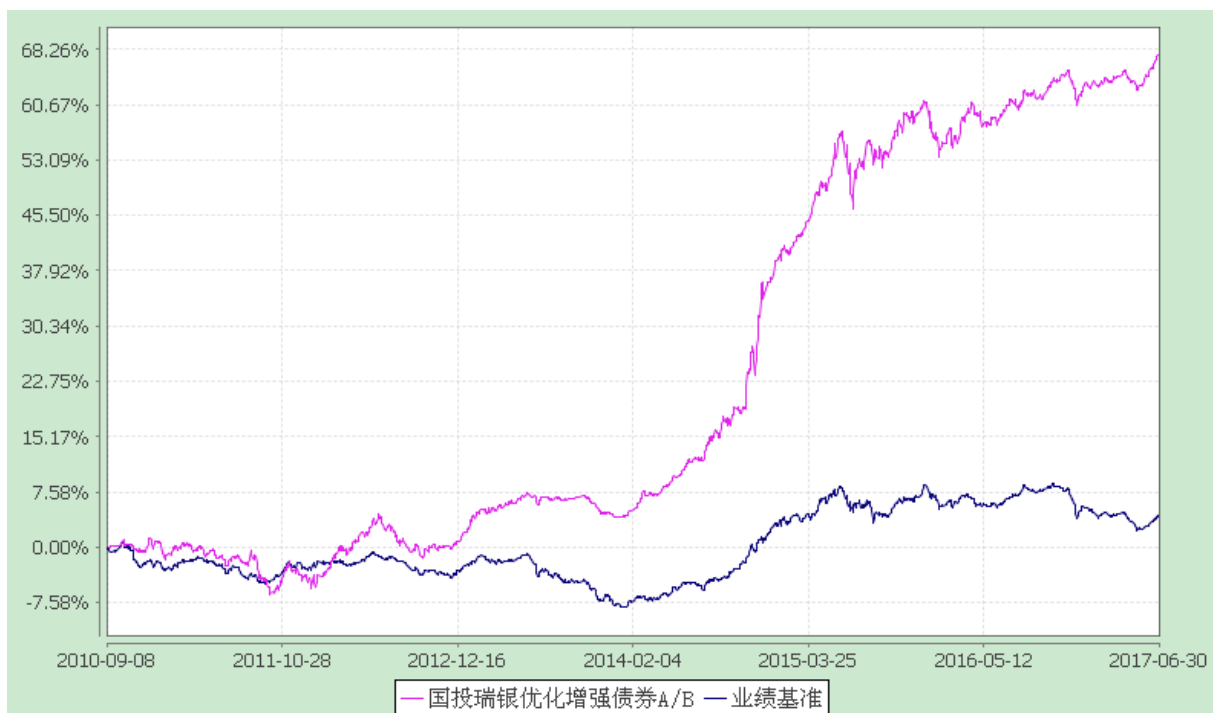
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

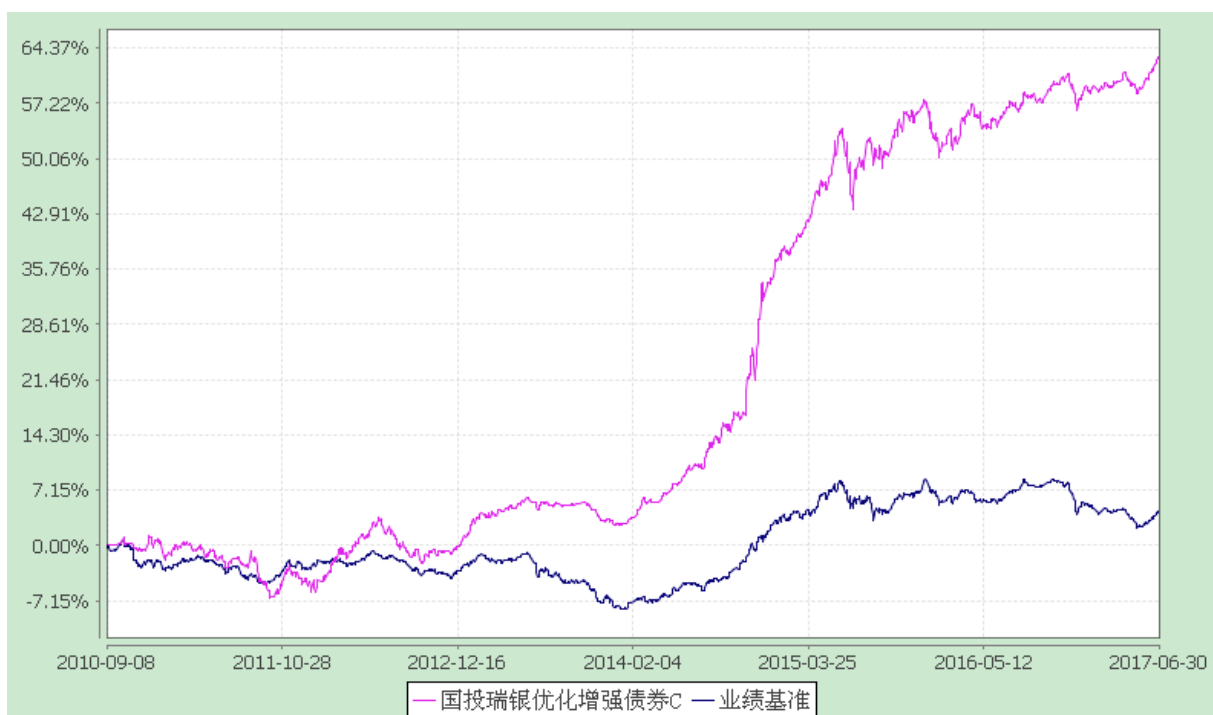
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 9 月 8 日至 2017 年 6 月 30 日)

国投瑞银优化增强债券 A/B



国投瑞银优化增强债券 C



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 3 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		
李怡文	本基金基金经理、固定收益部副总监	2010-09-08	-	16	中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任 Frolely Revy Investment Company 分析师、中国建设银行（香港）资产组合经理。2008 年 6 月加入国投瑞银，曾任国投瑞银纯债债券型证券投资基金、国投瑞银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银岁增利一年期定期开放债券型证券投资基金和国投瑞银招财保本混合型证券投资基金基金经理。现任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金、国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金、国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金和国投瑞银和安债券型证券投资基金基金

					经理。
狄晓娇	本基金基金经理	2015-06-27	-	8	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2010 年 7 月加入国投瑞银基金，2011 年 7 月转入固定收益部任研究员。现任国投瑞银优化增强债券型证券投资基金、国投瑞银进宝保本混合型证券投资基金、国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金、国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银瑞宁灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银新动力灵活配置混合型证券投资基金及国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。
董晗	本基金基金经理	2017-05-20	-	11	中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司金属、非金属行业研究员，2007 年 9 月加入国投瑞银。曾任国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金（LOF）和国投瑞银景气行业证券投资基金基金经理。现任国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银创新动力混合型证券投资基金、国投瑞银成长优选混合型证券投资基金、国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金、国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金、国投瑞银优化增强债券型证券投资基金及国投瑞银和安债券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《国投瑞银优化增强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

2017 年上半年，中国经济增长稳定，好于市场预期。其中，出口景气回升，固定资产投资较为平稳，房地产开发投资增速维持在高个位数，3、4 线城市的房地产销售和投资景气程度超市场预期。通胀压力不大，但流动性宽松不再。上半年央行货币政策保持稳健中性，流动性在 2 季度有明显收紧。

受金融去杠杆的影响，2 季度各类债券资管产品遭遇较大赎回压力，债券资产被普遍抛售，债市收益率大幅上行，股市也受到一定冲击。进入 6 月份以后，市场情绪有所缓和，收益率下行明显。

报告期内，本基金抓住 2 季度债券市场调整的机会，增加了对债券资产的配置，组合久期有所拉长。股票则维持相对较高的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A/B 级份额净值为 1.312 元，本基金 C 级份额净值为 1.308 元，本基金 A/B 级份额净值增长率为 3.17%，C 级份额净值增长率为 3.13%，同期业绩比较基准收益率为-1.21%。

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 2017 年下半年，我们预计央行货币政策将保持稳健，流动性过紧或者过松的可能性都不大，而考虑到中国经济继续展现出一定的韧性，我们预期债券市场收益率将保持震荡，我们对债券资产将以持有为主。而对股票的配置将逐步回归中性，配置方向仍然是基本面稳健、估值合理的个股。

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

国投瑞银优化增强债券 A/B 级份额本期已实现收益为 28,627,096.31 元，期末可供

分配利润为 201,587,720.81 元；报告期内本基金共实施 1 次收益分配，累计分配 308,717,533.52 元，每 10 份基金份额分红 2.94 元。

国投瑞银优化增强债券 C 级份额本期已实现收益为 23,380,487.97 元，期末可供分配利润为 90,392,239.86 元；报告期内本基金共实施 1 次收益分配，累计分配 1,913,770,556.47 元，每 10 份基金份额分红 2.86 元。

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。

国投瑞银优化增强债券 A/B 级份额本期已实现收益为 28,627,096.31 元，期末可供分配利润为 201,587,720.81 元；报告期内本基金共实施 1 次收益分配，累计分配 308,717,533.52 元，每 10 份基金份额分红 2.94 元。

国投瑞银优化增强债券 C 级份额本期已实现收益为 23,380,487.97 元，期末可供分配利润为 90,392,239.86 元；报告期内本基金共实施 1 次收益分配，累计分配 1,913,770,556.47 元，每 10 份基金份额分红 2.86 元。

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：国投瑞银优化增强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	附注号	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	6.4.7.1	36,330,185.54	9,366,876.97
结算备付金		9,310,770.00	6,604,722.43
存出保证金		220,277.40	296,073.65
交易性金融资产	6.4.7.2	2,079,130,724.60	1,686,214,296.24
其中：股票投资		248,656,150.50	213,682,357.84
基金投资		-	-
债券投资		1,830,474,574.10	1,472,531,938.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	58,896,249.95	38,000,000.00
应收证券清算款		12,536,141.08	1,488,000.83
应收利息	6.4.7.5	23,084,239.05	19,913,720.74
应收股利		-	-
应收申购款		16,858,455.37	609,947.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,236,367,042.99	1,762,493,637.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		447,200,000.00	375,259,469.76
应付证券清算款		8,845,463.70	-
应付赎回款		6,791,674.83	634,588.74
应付管理人报酬		1,060,541.57	1,192,037.38
应付托管费		282,811.08	317,876.64
应付销售服务费		174,989.40	125,438.64
应付交易费用	6.4.7.7	248,275.79	828,830.05

应交税费		878,765.06	878,765.06
应付利息		1,135,566.14	177,830.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	293,513.77	390,002.36
负债合计		466,911,601.34	379,804,839.43
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,349,690,968.33	886,120,548.65
未分配利润	6.4.7.10	419,764,473.32	496,568,249.79
所有者权益合计		1,769,455,441.65	1,382,688,798.44
负债和所有者权益总计		2,236,367,042.99	1,762,493,637.87

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.312 元，C 类基金份额净值人民币 1.308 元，基金份额总额 1,349,690,968.33 份，其中 A 类基金份额 925,828,526.24 份； C 类基金份额 423,862,442.09 份。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银优化增强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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 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		84,907,966.58	-16,434,686.32
1.利息收入		50,144,562.69	49,423,168.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,504,236.82	449,902.22
债券利息收入		31,066,512.92	48,590,366.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,573,812.95	382,900.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,866,123.29	-26,809,671.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,619,749.18	-33,211,812.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,126,216.70	4,048,162.52
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,120,157.41	2,353,978.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	13,854,014.70	-39,162,087.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	43,265.90	113,903.40
减：二、费用		19,046,367.60	22,640,631.38
1. 管理人报酬		8,762,801.43	11,782,333.66
2. 托管费		2,336,747.07	3,141,955.60
3. 销售服务费		2,224,042.48	1,602,018.56
4. 交易费用	6.4.7.18	1,266,714.31	4,604,159.17
5. 利息支出		4,215,694.66	1,250,347.56
其中：卖出回购金融资产支出		4,215,694.66	1,250,347.56
6. 其他费用	6.4.7.19	240,367.65	259,816.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65,861,598.98	-39,075,317.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65,861,598.98	-39,075,317.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银优化增强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 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）	886,120,548.65	496,568,249.79	1,382,688,798.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,861,598.98	65,861,598.98
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）	463,570,419.68	2,079,822,714.54	2,543,393,134.22
其中：1.基金申购款	7,440,254,006.31	4,152,253,771.88	11,592,507,778.19
2.基金赎回款	-6,976,683,586.63	-2,072,431,057.34	-9,049,114,643.97
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）	-	-2,222,488,089.99	-2,222,488,089.99
五、期末所有者权益（基金净值）	1,349,690,968.33	419,764,473.32	1,769,455,441.65
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)	2,455,570,515.55	1,334,439,892.65	3,790,010,408.20
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	-39,075,317.70	-39,075,317.70
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)	-646,941,341.81	-326,898,847.67	-973,840,189.48
其中：1.基金申购款	1,569,209,148.08	805,110,285.07	2,374,319,433.15
2.基金赎回款	-2,216,150,489.89	-1,132,009,132.74	-3,348,159,622.63
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)	1,808,629,173.74	968,465,727.28	2,777,094,901.02

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

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金(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[2010]第 888 号《关于核准国投瑞银优化增强债券型证券投资基金募集的批复》核准，由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银优化增强债券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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,986,200,594.41 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 220 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,986,494,944.94 份基金份额，其中认购资金利息折合 294,350.53 份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》和《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金招募说明书》，投资者(即投资人)认购、申购时收取前端认购、申购

费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类；在投资者赎回时收取后端认购/申购费用和赎回费用的基金份额，称为 B 类；从基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购以及赎回费用的基金份额，称为 C 类。本基金 A 类、B 类、C 类三种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A/B 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别/级别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银优化增强债券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债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中权证投资的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：中债总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资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。

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 半年度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 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

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

本基金本期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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) 于 2016 年 5 月 1 日前，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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	16,330,185.54
定期存款	20,000,000.00	
其中：存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月-1 年	-	
存款期限 1 个月以内	20,000,000.00	
其他存款	-	
合计	36,330,185.54	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	237,817,404.48	248,656,150.50	10,838,746.02
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	877,231,772.38	882,823,574.10
	银行间市场	950,778,162.10	947,651,000.00
	合计	1,828,009,934.48	1,830,474,574.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,065,827,338.96	2,079,130,724.60	13,303,385.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	39,000,000.00	-
银行间市场	19,896,249.95	-
合计	58,896,249.95	-

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,905.84
应收定期存款利息	21,333.36
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,770.91
应收债券利息	23,048,130.05
应收买入返售证券利息	4,339.11
应收申购款利息	140.43
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,619.35
合计	23,084,239.05

注：其他为应收交易保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	237,967.69
银行间市场应付交易费用	10,308.10
合计	248,275.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	117.08
信息披露费	248,765.71
审计费用	44,630.98
合计	293,513.77

6.4.7.9 实收基金

国投瑞银优化增强债券 A/B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	729,514,966.90	729,514,966.90
本期申购	439,509,950.91	439,509,950.91
本期赎回（以“-”号填列）	-243,196,391.57	-243,196,391.57
本期末	925,828,526.24	925,828,526.24

国投瑞银优化增强债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	156,605,581.75	156,605,581.75
本期申购	7,000,744,055.40	7,000,744,055.40
本期赎回（以“-”号填列）	-6,733,487,195.06	-6,733,487,195.06
本期末	423,862,442.09	423,862,442.09

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

国投瑞银优化增强债券 A/B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	349,883,417.14	60,438,353.69	410,321,770.83
本期利润	28,627,096.31	7,817,515.03	36,444,611.34
本期基金份额交易产生的变动数	131,794,740.88	19,172,081.20	150,966,822.08
其中：基金申购款	203,679,888.73	40,068,900.30	243,748,789.03
基金赎回款	-71,885,147.85	-20,896,819.10	-92,781,966.95
本期已分配利润	-308,717,533.52	-	-308,717,533.52
本期末	201,587,720.81	87,427,949.92	289,015,670.73

国投瑞银优化增强债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,176,994.75	13,069,484.21	86,246,478.96
本期利润	23,380,487.97	6,036,499.67	29,416,987.64
本期基金份额交易产生的变动数	1,907,605,313.61	21,250,578.85	1,928,855,892.46
其中：基金申购款	3,273,885,828.35	634,619,154.50	3,908,504,982.85
基金赎回款	-1,366,280,514.74	-613,368,575.65	-1,979,649,090.39

本期已分配利润	-1,913,770,556.47	-	-1,913,770,556.47
本期末	90,392,239.86	40,356,562.73	130,748,802.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	496,823.88
定期存款利息收入	6,528,333.36
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	59,772.47
其他	419,307.11
合计	7,504,236.82

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	418,198,000.76
减：卖出股票成本总额	406,578,251.58
买卖股票差价收入	11,619,749.18

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,857,456,413.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,815,762,631.85
减：应收利息总额	34,567,564.55
买卖债券差价收入	7,126,216.70

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期未进行衍生工具投资。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,120,157.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,120,157.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	13,854,014.70
——股票投资	9,224,707.55
——债券投资	4,629,307.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	13,854,014.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	43,258.10
基金转换费收入	7.80
合计	43,265.90

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,253,464.31
银行间市场交易费用	13,250.00
合计	1,266,714.31

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	28,370.96
其他费用	18,600.00
合计	240,367.65

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告送出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1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
安信证券	89,901,442.78	11.00%	-	-

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。

6.4.10.1.2 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

安信证券	83,725.11	11.00%	-	-
------	-----------	--------	---	---

注：1、上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

2、该类席位租用协议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。

3、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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1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
当期发生的基金应支付的管理费	8,762,801.43	11,782,333.66
其中：支付销售机构的客户维护费	155,959.15	193,975.33

注：支付基金管理人国投瑞银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 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 × 0.75% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1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
当期发生的基金应支付的托管费	2,336,747.07	3,141,955.60

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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	
	国投瑞银优化增	国投瑞银优化增强债
		合计

	强债券 A/B	券 C	
国投瑞银基金管 理有限公司	-	2,133,650.69	2,133,650.69
中国建设银行	-	20,306.60	20,306.60
安信证券股份有 限公司	-	-	-
合计	-	2,153,957.29	2,153,957.29
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		
	国投瑞银优化增 强债券A/B	国投瑞银优化增强债 券C	合计
中国建设银行	-	24,541.24	24,541.24
国投瑞银基金管 理有限公司	-	1,500,520.45	1,500,520.45
合计	-	1,525,061.69	1,525,061.69

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国投瑞银基金管理有限公司，再由国投瑞银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40 \% / \text{当年天数}。$$

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。

6.4.10.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的各关 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 入	交易金额	利息支 出
中国建设银行 股份有限公司	-	50,727,07 6.03	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	-	50,194,573.77	-	-	100,000,000.00	37,479.45

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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的情况。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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1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	16,330,185.54	496,823.88	1,881,611.43

6.4.10.6 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未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

国投瑞银优化增强债券 A/B

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配 合计
1	2017-03-28	2017-03-28	2.940	299,342,404.13	9,375,129.39	308,717,533.52
合计			2.940	299,342,404.13	9,375,129.39	308,717,533.52

国投瑞银优化增强债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配 合计
1	2017-03-28	2017-03-28	2.860	1,909,897,035.39	3,873,521.08	1,913,770,556.47
合计			2.860	1,909,897,035.39	3,873,521.08	1,913,770,556.47

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.24	2017-08-02	11.36	846,531.00	9,852,965.71	8,668,477.44
600485	信威	2016-12-26	重大	14.59	-	-	317,225.00	5,727,520.02	4,628,312.75

集团		事项						
----	--	----	--	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止,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 447,200,000.00 元,于 2017 年 7 月 3 日、7 月 4 日、7 月 5 日、7 月 6 日、7 月 7 日、7 月 10 日、7 月 12 日、7 月 13 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型基金,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。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人秉承全面风险控制的理念,将风险管理融入业务中,使风险控制与投资业务紧密结合,在董事会专业委员会监督管理下,建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在存放定期存款前,均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 83.74%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末	上年末
--------	-----	-----

	2017年6月30日	2016年12月31日
A-1	-	50,140,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	152,185,791.50	570,458,400.00
合计	152,185,791.50	620,598,400.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票、同业存单和部分短期融资券。

3.债券投资以净价列示。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	1,272,056,307.50	598,450,952.20
AAA 以下	139,361,585.20	233,460,586.20
未评级	266,870,889.90	20,022,000.00
合计	1,678,288,782.60	851,933,538.40

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3.债券投资以净价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人持续进行本基金的流动性需求分析，构建投资组合时，对备选证券进行流动性检验，并以适度分散策略保持组合流动性，严格控制缺乏流动性资产的比例。同时通过独立的风险管理部门设定基金的流动性比例控制要求，对现金类资产配置策略、股票集中度、重仓证券的流动性以及冲击成本率、换手率和交易活跃度等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

除卖出回购金融资产款余额中有 1,000,000.00 元将在 1 个月内到期且计息外，本基金所持有的其他全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人执行灵活的利率管理策略规避利率风险，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,330,185.54	-	-	-	36,330,185.54
结算备付金	9,310,770.00	-	-	-	9,310,770.00
存出保证金	220,277.40	-	-	-	220,277.40
交易性金融资产	384,664,595.00	1,049,630,272.70	396,179,706.40	248,656,150.50	2,079,130,724.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	58,896,249.95	-	-	-	58,896,249.95
应收证券清算款	-	-	-	12,536,141.08	12,536,141.08
应收利息	-	-	-	23,084,239.05	23,084,239.05

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	16,858,455.37	16,858,455.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	489,422,077.89	1,049,630,272.70	396,179,706.40	301,134,986.00	2,236,367,042.99
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	447,200,000.00	-	-	-	447,200,000.00
应付证券清算款	-	-	-	8,845,463.70	8,845,463.70
应付赎回款	-	-	-	6,791,674.83	6,791,674.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,060,541.57	1,060,541.57
应付托管费	-	-	-	282,811.08	282,811.08
应付销售服务费	-	-	-	174,989.40	174,989.40
应付交易费用	-	-	-	248,275.79	248,275.79
应交税费	-	-	-	878,765.06	878,765.06
应付利息	-	-	-	1,135,566.14	1,135,566.14
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	293,513.77	293,513.77
负债总计	447,200,000.00	-	-	19,711,601.34	466,911,601.34
利率敏感度缺口	42,222,077.89	1,049,630,272.70	396,179,706.40	281,423,384.66	1,769,455,441.65
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	9,366,876.97	-	-	-	9,366,876.97
结算备付金	6,604,722.43	-	-	-	6,604,722.43
存出保证金	296,073.65	-	-	-	296,073.65
交易性金融资产	810,855,619.50	571,677,561.10	89,998,757.80	213,682,357.84	1,686,214,296.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	38,000,000.00	-	-	-	38,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,488,000.83	1,488,000.83
应收利息	-	-	-	19,913,720.74	19,913,720.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	609,947.01	609,947.01
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	865,123,292.55	571,677,561.10	89,998,757.80	235,694,026.42	1,762,493,637.87
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	375,259,469.76	-	-	-	375,259,469.76
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	634,588.74	634,588.74
应付管理人报酬	-	-	-	1,192,037.38	1,192,037.38
应付托管费	-	-	-	317,876.64	317,876.64
应付销售服务费	-	-	-	125,438.64	125,438.64
应付交易费用	-	-	-	828,830.05	828,830.05
应交税费	-	-	-	878,765.06	878,765.06
应付利息	-	-	-	177,830.80	177,830.80
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	390,002.36	390,002.36
负债总计	375,259,469.76	-	-	4,545,369.67	379,804,839.43

					43
利率敏感度缺口	489,863,822.79	571,677,561.10	89,998,757.80	231,148,656.75	1,382,688,798.44

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	18,817,607.73	6,514,711.38
	市场利率上升 25 个基点	-18,356,339.88	-6,443,569.68

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金债券类资产的投资比例为不低于基金资产的 80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行

风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	248,656,150.50	14.05	213,682,357.84	15.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	248,656,150.50	14.05	213,682,357.84	15.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	基金业绩比较基准增加 5%	64,257,225.83	93,865,254.52
基金业绩比较基准减少 5%	-64,257,225.83	-93,865,254.52	

注：基金业绩比较基准 = 中债总指数收益率 × 90% + 沪深 300 指数收益率 × 10%。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 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 10 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。

(2) 除以上事项外，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	248,656,150.50	11.12
	其中：股票	248,656,150.50	11.12
2	固定收益投资	1,830,474,574.10	81.85
	其中：债券	1,830,474,574.10	81.85
	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	58,896,249.95	2.63

	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	45,640,955.54	2.04
7	其他各项资产	52,699,112.90	2.36
8	合计	2,236,367,042.99	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

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	105,048,287.94	5.94
C	制造业	74,886,977.00	4.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,311,888.32	1.03
F	批发和零售业	11,742,385.96	0.66
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	26,006,593.28	1.47
K	房地产业	6,922,812.00	0.39
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	5,737,206.00	0.32
S	综合	-	-

	合计	248,656,150.50	14.05
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	14,216,280.00	84,302,540.40	4.76
2	000968	蓝焰控股	1,434,699.00	20,745,747.54	1.17
3	600019	宝钢股份	2,737,925.00	18,371,476.75	1.04
4	601668	中国建筑	1,891,724.00	18,311,888.32	1.03
5	601328	交通银行	2,504,200.00	15,425,872.00	0.87
6	600835	上海机电	705,427.00	14,912,726.78	0.84
7	600030	中信证券	621,664.00	10,580,721.28	0.60
8	002456	欧菲光	492,700.00	8,952,359.00	0.51
9	002013	中航机电	846,531.00	8,668,477.44	0.49
10	600998	九州通	380,366.00	8,200,690.96	0.46
11	002314	南山控股	1,034,800.00	6,922,812.00	0.39
12	300336	新文化	371,100.00	5,737,206.00	0.32
13	300203	聚光科技	184,669.00	5,192,892.28	0.29
14	600485	信威集团	317,225.00	4,628,312.75	0.26
15	000400	许继电气	251,600.00	4,518,736.00	0.26
16	000157	中联重科	802,600.00	3,603,674.00	0.20

			0		
17	600859	王府井	219,300.00	3,541,695.00	0.20
18	002050	三花智控	201,300.00	3,285,216.00	0.19
19	002206	海利得	238,800.00	1,774,284.00	0.10
20	002215	诺普信	115,700.00	978,822.00	0.06

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	600887	伊利股份	59,951,627.00	4.34
2	600028	中国石化	44,284,064.00	3.20
3	600004	白云机场	34,408,948.65	2.49
4	600019	宝钢股份	26,775,615.82	1.94
5	601668	中国建筑	22,684,778.00	1.64
6	600362	江西铜业	15,842,816.00	1.15
7	601800	中国交建	15,381,861.00	1.11
8	601111	中国国航	15,081,116.68	1.09
9	600835	上海机电	15,058,677.94	1.09
10	000761	本钢板材	12,043,554.00	0.87
11	601328	交通银行	11,277,460.00	0.82
12	601186	中国铁建	10,602,507.79	0.77
13	002456	欧菲光	8,844,678.91	0.64
14	600085	同仁堂	8,467,836.00	0.61
15	000725	京东方 A	7,794,904.00	0.56
16	000983	西山煤电	7,651,481.61	0.55
17	601699	潞安环能	7,651,206.80	0.55
18	600998	九州通	7,615,171.96	0.55
19	002314	南山控股	7,581,422.00	0.55
20	600999	招商证券	7,496,683.00	0.54

注：“买入金额”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	600887	伊利股份	59,901,406.54	4.33
2	600004	白云机场	35,062,069.39	2.54
3	601111	中国国航	18,480,402.76	1.34
4	601800	中国交建	17,227,901.33	1.25
5	000538	云南白药	16,828,392.88	1.22
6	601688	华泰证券	15,753,438.36	1.14
7	000778	新兴铸管	15,561,073.84	1.13
8	600362	江西铜业	14,851,941.58	1.07
9	601009	南京银行	14,353,874.22	1.04
10	002239	奥特佳	13,501,252.58	0.98
11	000761	本钢板材	11,407,350.00	0.83
12	600030	中信证券	10,509,041.00	0.76
13	600015	华夏银行	10,061,439.20	0.73
14	601186	中国铁建	9,592,323.13	0.69
15	600085	同仁堂	9,331,193.12	0.67
16	300463	迈克生物	8,069,319.39	0.58
17	600019	宝钢股份	8,007,731.55	0.58
18	000725	京东方 A	7,920,224.00	0.57
19	601699	潞安环能	7,703,399.40	0.56
20	002013	中航机电	7,420,740.00	0.54

注：“卖出金额”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

买入股票的成本（成交）总额	432,327,336.69
卖出股票的收入（成交）总额	418,198,000.76

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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	164,251,681.40	9.28
2	央行票据	-	-

3	金融债券	184,570,000.00	10.43
	其中：政策性金融债	184,570,000.00	10.43
4	企业债券	598,664,014.10	33.83
5	企业短期融资券	70,235,000.00	3.97
6	中期票据	671,385,000.00	37.94
7	可转债（可交换债）	141,368,878.60	7.99
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,830,474,574.10	103.45

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	160210	16 国开 10	1,900,000	174,591,000.00	9.87
2	101451061	14 万科 MTN001	800,000	80,400,000.00	4.54
3	113011	光大转债	700,270	73,577,368.90	4.16
4	101651022	16 中生科技 MTN001	700,000	68,649,000.00	3.88
5	136789	16 东航 01	700,000	65,359,000.00	3.69

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	220,277.40
2	应收证券清算款	12,536,141.08
3	应收股利	-
4	应收利息	23,084,239.05
5	应收申购款	16,858,455.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,699,112.90

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	132002	15 天集 EB	30,516,114.00	1.72
2	110032	三一转债	9,866,340.00	0.56
3	110033	国贸转债	1,963,403.60	0.11
4	120001	16 以岭 EB	1,169,151.00	0.07
5	128013	洪涛转债	594,631.00	0.03

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	002013	中航机电	8,668,477.44	0.49	重大事项停牌

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
国投瑞银优化增强债券 A/B	11,902	77,787.64	883,783,338.67	95.46%	42,045,187.57	4.54%
国投瑞银优化增强债券 C	2,231	189,987.65	380,248,367.86	89.71%	43,614,074.23	10.29%
合计	14,133	95,499.25	1,264,031,706.53	93.65%	85,659,261.80	6.35%

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	国投瑞银优化增强债券 A/B	692,391.50	0.07%
	国投瑞银优化增强债券 C	266,659.34	0.06%
	合计	959,050.84	0.07%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国投瑞银优化增强债券 A/B	0
	国投瑞银优化增强债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国投瑞银优化增强债券 A/B	10~50
	国投瑞银优化增强债券 C	10~50
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国投瑞银优化增强债券 A/B	国投瑞银优化增强债券 C
基金合同生效日（2010 年 9 月 8 日）基金份额总额	2,247,615,987.38	1,738,878,957.56
本报告期期初基金份额总额	729,514,966.90	156,605,581.75
本报告期基金总申购份额	439,509,950.91	7,000,744,055.40
减：本报告期基金总赎回份额	243,196,391.57	6,733,487,195.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	925,828,526.24	423,862,442.09

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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普华永道中天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

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	
		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
财达证券	1	563,898,560.45	68.97%	525,157.07	68.97%
广发证券	1	163,779,941.17	20.03%	152,529.02	20.03%
安信证券	1	89,901,442.78	11.00%	83,725.11	11.00%

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		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
财达证券	497,740,938.24	61.62%	7,218,700,000.00	93.81%
广发证券	29,689,113.52	3.68%	386,000,000.00	5.02%
海通证券	280,267,529.51	34.70%	90,000,000.00	1.17%

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、本基金本报告期未发生交易所权证交易。
- 3、本基金本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	报告期内基金管理人对本基金分红进行公告	证券时报，中国证券报，上海证券报	2017-03-24
2	报告期内基金管理人对本基金持有的华星创业进行估值调整	上海证券报，中国证券报，证券时报	2017-05-06
3	报告期内基金管理人对本基金基金经理变更进行公告	证券时报，中国证券报	2017-05-20
4	报告期内基金管理人对本基金持有的中航机电进行估值调整	证券日报，证券时报，中国证券报，上海证券报	2017-05-24

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	20170322-20170405	-	2,295,918,367.34	2,060,204,081.63	235,714,285.71	17.46%
	2	20170101-20170302, 20170323-20170405	201,882,251.08	1,913,265,306.12	1,913,265,306.12	201,882,251.08	14.96%
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： 1、赎回申请延期办理的风险 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。							

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银优化增强债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]888号）

《关于国投瑞银优化增强债券型证券投资基金备案确认的函》（证监基金[2010]531号）

《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金 2017 年半年度报告原文

12.2 存放地点

深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日