

国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金
(原国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型)
2018年第3季度报告
2018年9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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金由国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型而来。国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金经中国证监会证监许可[2018]717 号文准予变更注册。国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型相关事项的议案》，内容包括将国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金变更为发起式基金，以及调整投资范围、投资策略、估值方法、基金份额的申购与赎回等，另外根据《流动性风险规定》在估值方法中增加摆动定价机制、在巨额赎回处理方式中增加发生巨额赎回时对单个基金份额持有人超过基金总份额一定比例以上的赎回申请实施延期办理赎回申请的具体措施等内容，并相应修订基金合同。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。根据基金份额持有人大会决议，自 2018 年 7 月 10 日起，《国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金》生效，《国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金》自同日起失效。转型后的基金投资目标、投资范围、投资策略以及风险收益特征与转型前差异较大。

相关公告刊登于《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的报告期自2018年7月10日(转型生效日)起至2018年9月30日止,国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型的报告期自2018年7月1日起至2018年7月9日止。

§2 基金产品概况

2.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

基金简称	国投瑞银顺鑫债券
基金主代码	002964
交易代码	002964
基金运作方式	<p>契约型、以定期开放方式运作。</p> <p>本基金以定期开放方式运作,即以封闭期和开放期相交替的方式运作。</p> <p>本基金第一个开放期的首日为本基金基金合同生效日的6个月后的月度对日,第二个开放期的首日为本基金基金合同生效日的12个月后的月度对日,第三个开放期的首日为本基金基金合同生效日的18个月后的月度对日,以此类推。本基金每个开放期不少于5个工作日并且最长不超过20个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。</p> <p>在开放期内,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。</p>
基金合同生效日	2018年7月10日
报告期末基金份额总额	1,003,455,855.04份
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,力争为投资人实现超越业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券投资组合,并管理组合风险。

	<p>(一) 基本价值评估</p> <p>债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线。本基金基于均衡收益率曲线，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>(二) 债券投资策略</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> <p>(三) 对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。</p> <p>(四) 组合构建及调整</p> <p>管理人结合债券研究管理团队的债券研究和投资管理经验，评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠，据此构建债券投资组合。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

2.2 国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金

基金简称	国投瑞银顺鑫一年债券
------	------------

基金主代码	002964
交易代码	002964
基金运作方式	<p>契约型、以定期开放方式运作。本基金以1年为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效日（包括基金合同生效日）或每个开放期结束之日次日起（包括该日）至1年后的对应日的前一日止。在运作周期内，本基金不办理申购与赎回业务（红利再投资除外），也不上市交易。本基金自每个运作周期结束之后第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。</p>
基金合同生效日	2016年7月13日
报告期末基金份额总额	10,013,580.65份
投资目标	<p>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，力争为投资人实现超越业绩比较基准的投资业绩。</p>
投资策略	<p>本基金采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券投资组合，并管理组合风险。</p> <p>1、债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线，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>2、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。</p> <p>3、为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。</p>

	4、管理人结合债券研究管理团队的债券研究和投资管理经验，评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠，据此构建债券投资组合。
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。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年7月10日- 2018年9月30日)	报告期 (2018年7月1日- 2018年7月9日)
1.本期已实现收益	6,662,693.25	-8,614.08
2.本期利润	7,439,639.87	-8,614.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075	-0.0006
4.期末基金资产净值	1,017,518,567.64	10,079,934.37
5.期末基金份额净值	1.0140	1.0066

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、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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

（报告期：2018年7月10日-2018年9月30日）

3.2.1.1 本报告期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

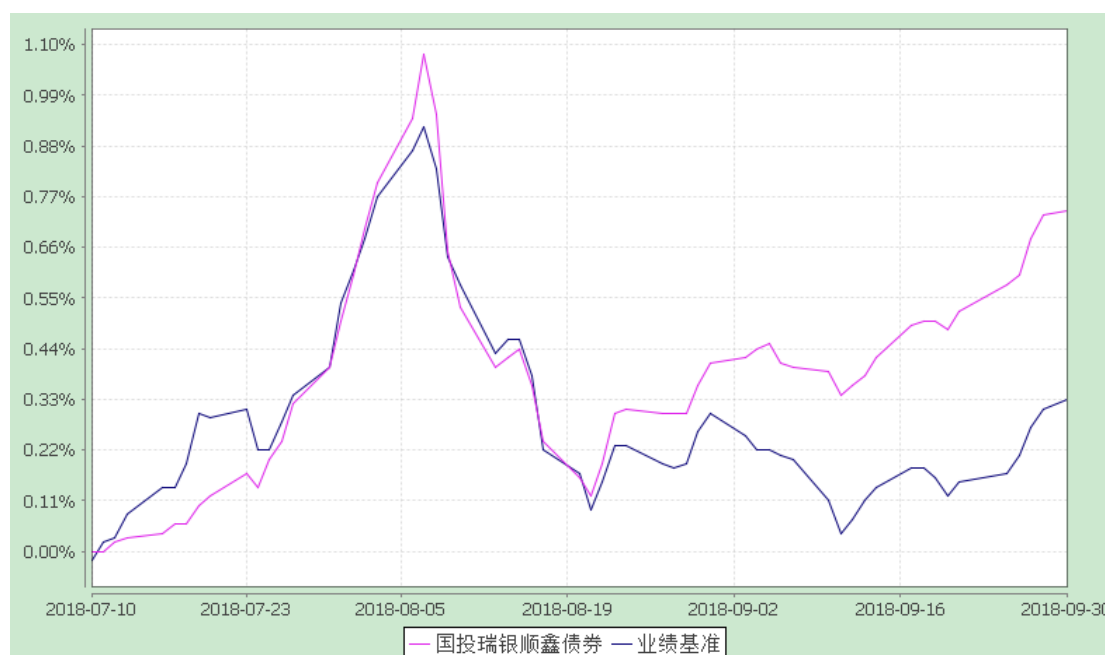
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.74%	0.07%	0.33%	0.07%	0.41%	0.00%

注：1、本基金由国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型而来并于2018年7月10日合同生效，因此上表报告期间的起始日为2018年7月10日。截止本报告期末本基金转型合同生效未满一年。本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.1.2 自基金转型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

国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金
 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
 (2018年7月10日-2018年9月30日)



注：1、本基金由国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型而来并于2018年7月10日合同生效，因此上图报告期间的起始日为2018年7月

10 日。截止本报告期末本基金转型合同生效未满一年。

2、本基金建仓期为自基金转型日起的六个月。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2.2 国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金

(报告期：2018年7月1日-2018年7月9日)

3.2.2.1 本报告期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

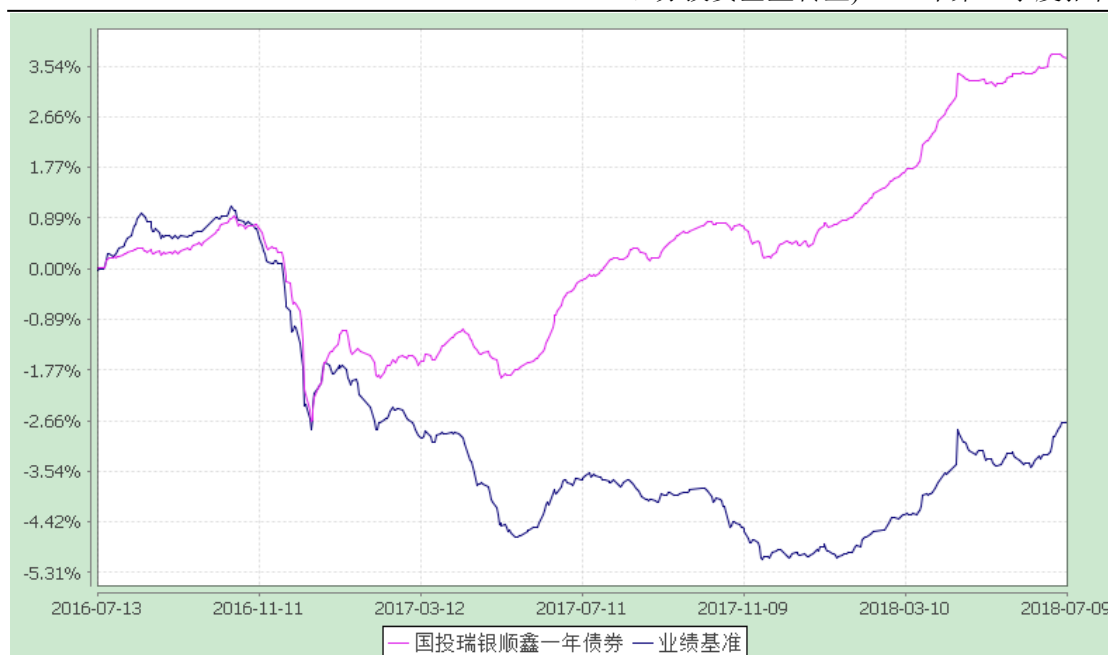
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.09%	0.01%	0.24%	0.04%	-0.33%	-0.03%

注：1、自2018年7月10日，国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型为国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金，因此上表报告期间的结束日为2018年7月9日。

2、中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，因此，本基金选取中债综合指数收益率作为业绩比较基准。

3.2.2.2 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

国投瑞银顺鑫一年期定期开放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
(2016 年 7 月 13 日-2018 年 7 月 9 日)



注：1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。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。

2、自2018年7月10日，国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型为国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金，因此上图报告期间的结束日为2018年7月9日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
狄晓娇	本基金基金经理	2018-07-10	-	9	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。曾任国投瑞银进宝灵活配置混合型证券投资基金（原国投瑞银进宝保本混合型证券投资基金）、国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金、国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金经理。现

国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(原国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型)2018年第3季度报告

					任国投瑞银岁添利一年期定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（原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、国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国投瑞银顺源6个月定期开放债券型证券投资基金、国投瑞银顺银6个月定期开放债券型发起式证券投资基金和国投瑞银顺泓定期开放债券型证券投资基金基金经理。
颜文浩	本基金基金经理	2018-07-10	-	8	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2010年10月加入国投瑞银。曾任国投瑞银瑞易货币市场基金、国投瑞银瑞达混合型证券投资基金基金经理。现任国投瑞银钱多宝货币市场基金、国投瑞银增利宝货币市场基金、国投瑞银添利宝货币市场基金、国投瑞银招财灵活配置混合型证券投资基金（原国投瑞银招财保本混合型证券投资基金）、国投瑞银全球债券精选证券投资基金、国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（原国投瑞银顺鑫一年期定期

					开放债券型证券投资基金)、国投瑞银融华债券型证券投资基金、国投瑞银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、国投瑞银货币市场基金和国投瑞银顺泓定期开放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遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，以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，形成了有效的公平交易体系。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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度债券收益率呈现震荡态势，组合在建仓期内逐步加仓，买入部分信

用债，利率债为主要投资标的，拉长组合久期。由于对后续通胀不确定的忧虑下，组合逐步减持了部分长久期利率债，后续将增加组合中中短期信用债的投资比例，利用杠杆增强组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金转型后截止报告期末，本基金份额净值为 1.014 元，本报告期份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.33%。

§5 投资组合报告

5.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期：2018年7月10日-2018年9月30日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	1,139,531,054.80	97.94
	其中：债券	1,139,531,054.80	97.94
	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	7,010,934.49	0.60
7	其他各项资产	17,017,136.47	1.46
8	合计	1,163,559,125.76	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。

5.1.2 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。

5.1.3 报告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。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	365,101,054.80	35.88
	其中：政策性金融债	153,975,000.00	15.13
4	企业债券	415,731,000.00	40.86
5	企业短期融资券	40,344,000.00	3.96
6	中期票据	181,851,000.00	17.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	86,139,000.00	8.47
9	其他	50,365,000.00	4.95
10	合计	1,139,531,054.80	111.99

5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1880114	18 铁道 15	900,000	91,449,000.00	8.99
2	180206	18 国开 06	700,000	71,792,000.00	7.06
3	10146401 5	14 连城投 MTN001	500,000	50,970,000.00	5.01
4	10180080 8	18 衡阳城投 MTN003	500,000	50,535,000.00	4.97
5	147746	18 四川 07	500,000	50,365,000.00	4.95

5.1.6 报告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。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明 细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本基金投资的前十名证券中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。

5.1.11.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	43,650.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,973,485.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,017,136.47

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末股票投资不存在流通受限情况。

5.1.11.6 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。

5.2 国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金

(报告期：2018年7月1日-2018年7月9日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,193,099.23	98.68
7	其他各项资产	136,257.40	1.32
8	合计	10,329,356.63	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。

5.2.2 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。

5.2.3 报告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。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 报告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。

5.2.7 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。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本基金投资的前十名证券中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。

5.2.11.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	35,032.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	101,224.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	136,257.40
---	----	------------

5.2.11.4 报告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。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末股票投资不存在流通受限情况。

5.2.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

6.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	10,013,580.65
本报告期期初基金份额总额	10,013,580.65
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	993,443,274.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,003,455,855.04

注：本基金由国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型而来并于2018年7月10日合同生效。

6.2 国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	30,236,746.62
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	20,223,165.97

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	-
本报告期期末基金份额总额	10,013,580.65

注：自2018年7月10日，国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金转型为国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金，因此上表报告期间的结束日为2018年7月9日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	报告期 (2018年7月10日- 2018年9月30日)	报告期 (2018年7月1日- 2018年7月9日)
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,928,514.69	9,928,514.69
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,928,514.69	9,928,514.69
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.99	99.15

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细。

7.2.2 国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

8.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

项目	持有份 额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份 额总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	9,928,51 4.69	0.99%	9,928,51 4.69	0.99%	自本基金成 立之日起三 年
基金管理人高级管理 人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,928,51 4.69	0.99%	9,928,51 4.69	0.99%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

9.1.1 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	20180710- 20180930	993,4 43,27	0.00	0.00	993,443,274 .39	99.00%

			4.39				
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>1、赎回申请延期办理的风险</p> <p>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延期办理的风险。</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险</p> <p>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。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险</p> <p>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。</p> <p>4、基金财产清算（或转型）的风险</p> <p>根据本基金基金合同的约定，基金合同生效之日起满三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元情形的，基金合同将终止，并根据基金合同的约定进行基金财产清算。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直接导致触发本基金合同约定的终止及清算条款，对本基金的继续存续产生较大影响。</p> <p>5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险</p> <p>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。</p>							

9.2 国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金

9.2.1 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
	1	20180701-	20,21	0.00	20,210,1	0.00	0.00%

机构		20180701	0,111.11		11.11		
	2	20180701-20180709	9,928,514.69	0.00	0.00	9,928,514.69	99.15%

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延缓支付赎回款项的风险。

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，在某个开放期届满时，若发生基金资产净值低于5000万元或份额持有人数量不满200人的，基金合同将终止，并根据基金合同的约定进行基金财产清算。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直接导致触发本基金合同约定的终止及清算条款，对本基金的继续存续产生较大影响。

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。

9.3 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内基金管理人对本基金转型为顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金进行提示性公告，指定媒体公告时间为 2018 年 7 月 2 日。

2、报告期内基金管理人对本基金基金合同生效进行公告，指定媒体公告时间为 2018 年 7 月 10 日。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金注册的批复》
(证监许可[2016]1375 号)

《关于国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金备案确认的函》
(机构部函[2016]1608 号)

《国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》

《国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

《国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式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

国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(原国投瑞银顺鑫一年期
定期开放债券型证券投资基金转型)2018 年第 3 季度报告原文

10.2 存放地点

中国广东省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>

10.3 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: 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日