

国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金
2018 年半年度报告摘要
2018 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 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	国投金融地产 ETF 联接	
基金主代码	161211	
交易代码	161211(前端)	161212(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 4 月 9 日	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	186,725,030.07 份	
基金合同存续期	不定期	

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：金地 ETF）
基金主代码	159933
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 17 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 10 月 16 日
基金管理人名称	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主要投资于目标 ETF 基金份额，力争实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
投资策略	1、资产配置策略 本基金为目标 ETF 的联接基金，投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。 2、目标 ETF 投资策略 本基金可以通过一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的投资，本基金将根据开放日申购赎回情况，综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标 ETF 的投资方

	式。此外，本基金还将适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。 3、股指期货投资策略 为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，以提高投资组合的运作效率。本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内。
业绩比较基准	95%×沪深 300 金融地产指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪基准指数。 当预期标的指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为，或因基金的申购与赎回以及其他特殊情况导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。 在正常市场情况下，本基金力求将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人将采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，以提高投资组合的运作效率。
业绩比较基准	沪深 300 金融地产指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金被动跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘凯	郭明
	联系电话	400-880-6868	010-66105798
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.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

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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	40,805,786.87
本期利润	-31,312,975.78
加权平均基金份额本期利润	-0.1404
本期基金份额净值增长率	-13.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3525
期末基金资产净值	252,553,310.27
期末基金份额净值	1.3525

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

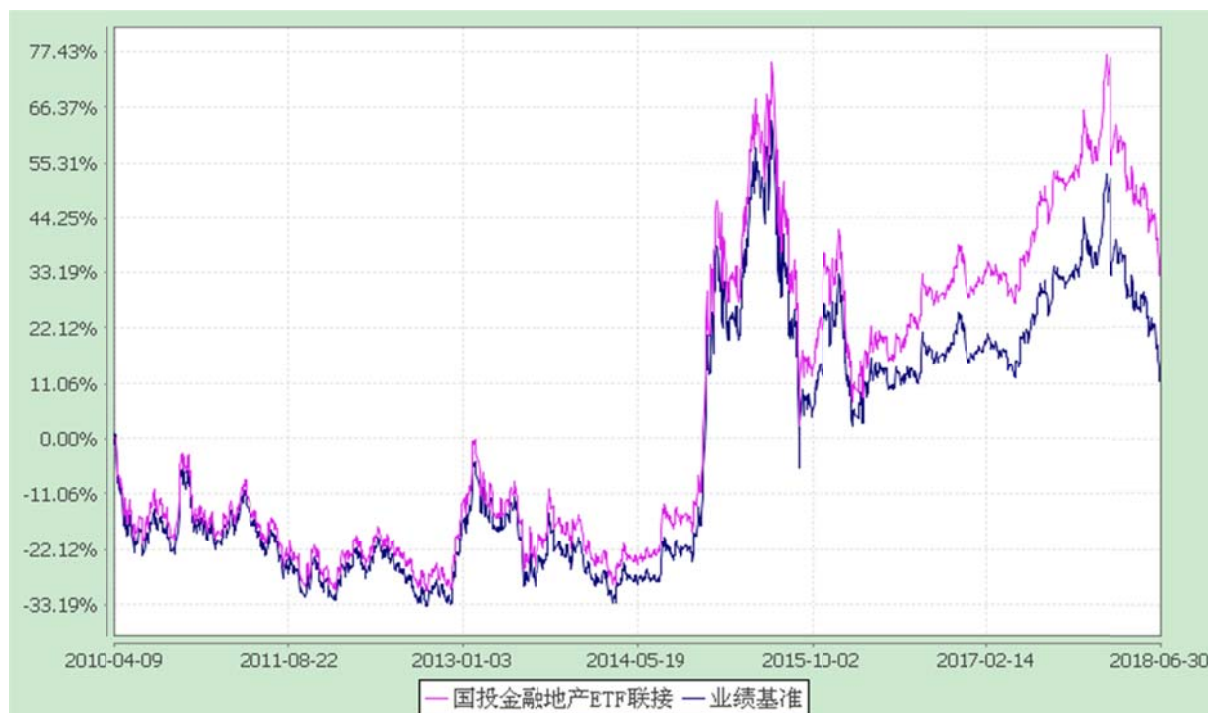
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	-5.78%	1.14%	-6.75%	1.19%	0.97%	-0.05%
过去三个月	-10.55%	1.08%	-12.19%	1.15%	1.64%	-0.07%
过去六个月	-13.51%	1.20%	-15.83%	1.26%	2.32%	-0.06%
过去一年	-4.22%	1.01%	-8.64%	1.07%	4.42%	-0.06%
过去三年	-10.01%	1.40%	-19.10%	1.41%	9.09%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	35.25%	1.55%	13.84%	1.55%	21.41%	0.00%

注：1、本基金是以国投瑞银沪深 300 金融地产交易型指数基金为目标的联接基金，对目标 ETF 的配置不低于基金资产净值 90%，故以 $95\% \times \text{沪深 300 金融地产指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 作为本基金业绩比较基准。

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

国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 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 4 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日）



注：2013 年 11 月 5 日起国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金（LOF）转型变更为国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金（简称“本基金”）。《国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 11 月 5 日起生效。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 2018 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 73 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 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		
赵建	本基金基金经理	2015-02-10	-	15	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于上海博弘投资有限公司、上海数君投资有限公司、上海一维科技有限公司。2010 年 6 月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)（原国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金）、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)、国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原国投瑞银沪深 300 金融地产指数基金）、国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金、国投瑞银白银期货证券投资基金(LOF) 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《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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%的交易情况。

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

2018 年上半年，国内经济仍然以平稳为主，基建和房地产投资边际走弱，社融增速逐步下行，但经济韧性较强，企业盈利维持高位。

本基金遵循 ETF 联接基金的被动投资原则，力求实现对业绩比较基准的紧密跟踪。操作上力保基金的平稳运作，做好基金的日常风险管控工作。同时在组合投资管理上严格控制跟踪误差，研究应对成分股调整等机会成本、同时也密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及相应市场出现的结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.3525 元，本报告期份额净值增长率为-13.51%，同期业绩比较基准收益率为-15.83%。

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 2018 年下半年，短期国内政策有缓和迹象但不改长期去杠杆压力，贸易摩擦会成为常态，对市场的心理冲击会逐步减少。A 股市场需要以时间消化中美贸易争端和

去杠杆演进的不确定性，以时间换取估值向上拓展的空间，底部会比较漫长和纠结。

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估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为 40,805,786.87 元，期末可供分配利润为 65,828,280.20 元。

本报告期本基金未进行收益分配。

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，本基金托管人在对国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

的管理人--国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	15,636,566.49	30,192,848.15
结算备付金	-	899,924.48
存出保证金	62,139.95	66,283.28
交易性金融资产	237,410,639.54	458,994,656.95
其中：股票投资	7,861,682.42	16,758,520.24
基金投资	229,548,957.12	442,236,136.71
债券投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,861.37	6,582.91
应收股利	-	-

应收申购款	177,382.93	123,371.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	253,289,590.28	490,283,667.09
负债和所有者权益	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	470,593.35	859,661.04
应付管理人报酬	12,108.36	24,489.09
应付托管费	2,623.49	5,305.94
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	73,830.53	159,271.25
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	177,124.28	356,027.25
负债合计	736,280.01	1,404,754.57
所有者权益：	-	-
实收基金	186,725,030.07	312,628,102.58
未分配利润	65,828,280.20	176,250,809.94
所有者权益合计	252,553,310.27	488,878,912.52
负债和所有者权益总计	253,289,590.28	490,283,667.09

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3525 元，基金份额总额 186,725,030.07 份。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	-30,571,125.09	38,277,300.40
1.利息收入	84,206.30	98,130.28
其中：存款利息收入	84,206.30	98,130.28

债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	0.00	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	41,225,999.01	7,171,709.50
其中：股票投资收益	1,845,363.27	-73,903.70
基金投资收益	39,298,894.58	7,156,628.23
债券投资收益	-	-
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	81,741.16	88,984.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-72,118,762.65	30,922,043.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	237,432.25	85,417.07
减：二、费用	741,850.69	511,029.73
1. 管理人报酬	97,183.12	113,589.12
2. 托管费	21,056.34	24,610.97
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	447,336.44	194,119.15
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	176,274.79	178,710.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-31,312,975.78	37,766,270.67
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-31,312,975.78	37,766,270.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	312,628,102.58	176,250,809.94	488,878,912.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-31,312,975.78	-31,312,975.78

期利润)			
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)	-125,903,072.51	-79,109,553.96	-205,012,626.47
其中: 1.基金申购款	43,106,704.03	26,786,950.94	69,893,654.97
2.基金赎回款	-169,009,776.54	-105,896,504.90	-274,906,281.44
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)	186,725,030.07	65,828,280.20	252,553,310.27
项目	上年度可比期间 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)	364,306,612.72	105,424,419.29	469,731,032.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,766,270.67	37,766,270.67
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)	-71,276,323.58	-22,424,796.98	-93,701,120.56
其中: 1.基金申购款	9,221,852.76	3,055,054.27	12,276,907.03
2.基金赎回款	-80,498,176.34	-25,479,851.25	-105,978,027.59
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)	293,030,289.14	120,765,892.98	413,796,182.12

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

国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"本

基金")是由国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)(以下简称"原基金")通过基金合同修订变更而来。原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 69 号《关于核准国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)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《国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,722,936,524.64 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 077 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 4 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,723,171,301.29 份基金份额,其中认购资金利息折合 234,776.65 份基金份额。原基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金基金份额持有人大会自 2013 年 9 月 9 日起至 2013 年 10 月 18 日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)变更为国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》,经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议,《国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》自 2013 年 11 月 5 日生效,基金投资目标、范围和策略调整,同时"国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)"更名为"国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金"。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2010]第 181 号文审核同意,原基金 496,448,878.00 份基金份额于 2010 年 6 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。本基金基金合同生效后,原基金场内份额转换为国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"目标 ETF")的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银沪深 300 金融地产指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,原基金的投资范围为沪深 300 金融地产指数成份股及其备选成份股、新股、债券、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。原基金投资于沪深 300 金融地产指数成份股票及其备选成份股票的投资比例不低于基金资产净值的 90%;现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值

的 5%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%；原基金对沪深 300 金融地产指数成份股的配置基准为 95%。原基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内。原基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 金融地产指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

本基金是目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是主要采用完全复制法实现对沪深 300 金融地产指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离交易可转债存债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及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的相关规定)。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内)；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 金融地产指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

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》、《国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年半年度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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。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。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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。存款利息收入不征收增值税。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。根据上海市虹口区税务局规定，地方教育费附加的税率于 2018 年 7 月 1 日起由之前的 2% 调整为 1%。

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

本报告期无与本基金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。

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金("目标 ETF")	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

6.4.8 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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	97,183.12	113,589.12
其中：支付销售机构的客户维护费	398,412.18	460,369.53

注：原基金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 0.60%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 × 0.60% / 当年天数。

本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取 0)的 0.6%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扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取 0) × 0.6% ÷ 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	21,056.34	24,610.97

注：原基金支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.13%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 × 0.13% / 当年天数。

本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取 0)的 0.13% 的年费率计提。其计算公式为：

日托管费 = 前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取 0) × 0.13% ÷ 当年天数

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行	15,636,566.49	83,041.31	29,026,982.53	96,138.08

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

于 2018 年 6 月 30 日,本基金持有 138,616,520.00 份目标 ETF 基金份额,占其总份额的比例为 94.37% (于 2017 年 6 月 30 日,本基金持有 215,116,520.00 份目标 ETF 基金份额,占其总份额的比例为 95.24%)。

6.4.9 期末(2018 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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	备注
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	4.87	-	-	178,200.00	873,099.00	867,834.00	-

6.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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	7,861,682.42	3.10
	其中:股票	7,861,682.42	3.10
2	基金投资	229,548,957.12	90.63
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,636,566.49	6.17
8	其他各项资产	242,384.25	0.10
9	合计	253,289,590.28	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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	21,454.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
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	6,145,066.72	2.43
K	房地产业	1,651,781.70	0.65
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	43,380.00	0.02
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	7,861,682.42	3.11

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	601318	中国平安	19,800.00	1,159,884.00	0.46
2	000540	中天金融	178,200.00	867,834.00	0.34
3	600036	招商银行	18,800.00	497,072.00	0.20
4	601166	兴业银行	22,800.00	328,320.00	0.13
5	600016	民生银行	43,300.00	303,100.00	0.12
6	601328	交通银行	50,300.00	288,722.00	0.11
7	601288	农业银行	69,989.00	240,762.16	0.10
8	600030	中信证券	14,400.00	238,608.00	0.09
9	000002	万科 A	8,900.00	218,940.00	0.09
10	601398	工商银行	39,500.00	210,140.00	0.08

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	2,787,543.00	0.57
2	600036	招商银行	1,186,179.14	0.24
3	601166	兴业银行	840,532.00	0.17
4	600016	民生银行	766,113.00	0.16
5	601328	交通银行	695,740.00	0.14
6	000002	万科 A	602,353.00	0.12

7	601288	农业银行	600,436.00	0.12
8	600030	中信证券	580,364.00	0.12
9	600000	浦发银行	563,493.00	0.12
10	601398	工商银行	540,066.55	0.11
11	601601	中国太保	444,107.00	0.09
12	601169	北京银行	410,510.00	0.08
13	000001	平安银行	407,233.00	0.08
14	600048	保利地产	404,321.83	0.08
15	600837	海通证券	389,705.00	0.08
16	601988	中国银行	337,884.00	0.07
17	601818	光大银行	265,953.00	0.05
18	601211	国泰君安	265,919.00	0.05
19	600015	华夏银行	232,122.00	0.05
20	601688	华泰证券	225,670.00	0.05

注：1、买入包括基金二级市场上主动地买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，不包括因本基金赎回标的 ETF 基金份额导致的基金组合中股票的增加；

2、"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	601318	中国平安	34,181,123.50	6.99
2	600036	招商银行	14,285,106.25	2.92
3	601166	兴业银行	9,783,375.50	2.00
4	600016	民生银行	8,996,920.00	1.84
5	601328	交通银行	7,896,813.00	1.62
6	000002	万科 A	7,889,665.82	1.61
7	600030	中信证券	7,118,198.21	1.46
8	601288	农业银行	7,086,960.71	1.45
9	600000	浦发银行	6,467,598.00	1.32
10	601398	工商银行	6,374,805.17	1.30
11	601601	中国太保	5,412,754.84	1.11
12	600048	保利地产	4,897,303.37	1.00
13	000001	平安银行	4,879,289.80	1.00
14	601169	北京银行	4,765,232.00	0.97
15	600837	海通证券	4,609,850.00	0.94
16	601988	中国银行	3,957,962.00	0.81
17	601211	国泰君安	3,128,801.98	0.64

18	601818	光大银行	3,036,995.00	0.62
19	601688	华泰证券	2,783,927.00	0.57
20	600015	华夏银行	2,698,475.00	0.55

注：1、卖出主要指二级市场上主动地卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，不包括因本基金申购标的 ETF 基金份额导致的基金组合中股票的减少；

2、"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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	17,445,818.29
卖出股票的收入（成交）总额	208,447,656.89

注：1、买入包括基金二级市场上主动地买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动地卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，不包括因本基金申购赎回标的 ETF 基金份额导致的基金组合中股票的增减；

2、"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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,以提高投资组合的运作效率。

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中,持有“浦发银行”市值 205,062 元,占基金资产净值 0.08%。根据上海浦东发展银行股份有限公司 2018 年 1 月 19 日公告,该公司成都分行因内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为收到中国银行业监督管理委员会四川监管局(以下简称“银监会四川监管局”)行政处罚决定书(川银监罚字【2018】2 号),银监会四川监管局对成都分行执行罚款 46,175 万元人民币。根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银监罚决字(2018)4 号),上海浦东发展银行股份有限公司因内控管理严重违反审慎经营规则;通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节等违反商业银行监管规定的违规行为受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚,对该公司罚款 5845 万元,没收违法所得 10.927 万元,罚没合计 5855.927 万元。基金管理人认为,该公司成都分行上述被处罚事项有利于公司加强内部管理,公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定,事件对该公司经营活动未产生实质性影响,不改变该公司基本面。

本基金投资的前十名证券中,持有“招商银行”市值 497,072.00 元,占基金资产净值 0.20%。根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1 号),招商银行股份有限公司因内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款,同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等违反商业银行监管法规的违规行为受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚,对该公司罚款 6570 万元,没收违法所得 3.024 万元,罚没合计 6573.024 万元。

基金管理人认为,该公司上述被处罚事项有利于公司加强内部管理,公司当前总体生产

经营和财务状况保持稳定，事件对该公司经营活动未产生实质性影响，不改变该公司基本面。

本基金投资的前十名证券中，持有“兴业银行”市值 328,320.00 元，占基金资产净值 0.13%。根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）1 号），兴业银行股份有限公司因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告，非真实转让信贷资产，无授信额度或超授信额度办理同业业务等违反商业银行监管规定的违规行为受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚，对该公司罚款 5870 万元。

基金管理人认为，该公司上述被处罚事项有利于公司加强内部管理，公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对该公司经营活动未产生实质性影响，不改变该公司基本面。

本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

除上述情况外，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 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。

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	62,139.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,861.37
5	应收申购款	177,382.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	242,384.25

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

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	000540	中天金融	867,834.00	0.34	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

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
17,187	10,864.32	6,046,029.97	3.24%	180,679,000.10	96.76%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	254,564.77	0.14%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 4 月 9 日）基金份额总额	1,723,171,301.29
本报告期期初基金份额总额	312,628,102.58
本报告期基金总申购份额	43,106,704.03
减：本报告期基金总赎回份额	169,009,776.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	186,725,030.07

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

报告期内本基金基金投资策略未发生改变。

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		备注
		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	
中信建投证券	3	108,699,774.88	48.12%	101,232.63	48.12%	-

长江证券	1	70,411,404.64	31.17%	65,574.29	31.17%	-
兴业证券	1	30,075,510.56	13.31%	28,009.44	13.31%	-
东吴证券	1	6,986,937.16	3.09%	6,506.90	3.09%	-
民生证券	1	6,946,629.25	3.08%	6,469.32	3.08%	-
华泰证券	2	2,340,382.55	1.04%	2,179.59	1.04%	-
方正证券	1	432,836.14	0.19%	403.07	0.19%	-

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、本报告期本基金未发生交易所债券、回购及权证交易。

3、本基金本报告期退租中信证券 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	20180101-20180329	86,844,710.51	0.00	86,844,710.51	0.00	0.00%
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。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日