国投瑞银全球债券精选证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年三月二十八日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 4 月 19 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银全球债券精选(QDII-FOF)	
基金主代码	002467	
交易代码	002467	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 19 日	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	83,324,303.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银全球债券(QDII)人民币	国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇
下属分级基金的交易代码	002467	002468
报告期末下属分级基金的份额总额	68,901,317.49 份	14,422,986.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球债券市场,通过运用基金中基金(FOF:Fund of Funds)这种国际流行的投资管理模式,在全球范围内精选优质债券基金,在严格控制组合风险的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过自上而下的资产配置和自下而上的债券基金、债券精选策略进行基金资产的投资组合构建,注重各区域与国家的宏观经济环境、政治形势、总体经济指标、景气周期、货币政策、利率水平、信用市场的利差变化等的综合分析,并根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征,由此确定基金资产在国家与地区间的区域配置以及在各债券基金、债券和现金等资产类别上的投资比例。
业绩比较基准	Barclays Global Aggregate Index
风险收益特征	本基金为基金中基金,投资于境外的债券型交易型开放式指数基金(债券型 ETF)、主动管理的债券型公募基金、债券合计不低于本基金基金资产的 80%,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	王永民
	联系电话	400-880-6868	010-66594896
	电子邮箱	service@ubssdic.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-880-6868	95566
传真		0755-82904048	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	国投瑞银全球债券(QDII)人民币	国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇
本期已实现收益	2,475,086.28	2,736,066.59
本期利润	4,214,789.99	5,351,932.54
加权平均基金份额本期利润	0.0448	0.3421
本期加权平均净值利润率	4.35%	5.12%
本期基金份额净值增长率	5.40%	-1.70%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0269	0.2146
期末基金资产净值	72,602,424.74	98,369,890.08
期末基金份额净值	1.054	6.820

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(例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

5、本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 19 日。至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

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

1. 国投瑞银全球债券(QDII)人民币:

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
过去三个月	1.25%	0.22%	-7.07%	0.47%	8.32%	-0.25%
过去六个月	2.23%	0.27%	-6.31%	0.40%	8.54%	-0.13%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.27%	-4.28%	0.37%	9.68%	-0.10%

2. 国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇:

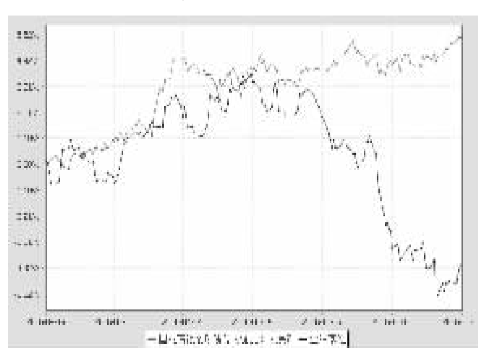
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.58%	0.24%	-7.07%	0.47%	4.49%	-0.23%
过去六个月	-2.29%	0.21%	-6.31%	0.40%	4.02%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-1.70%	0.19%	-4.28%	0.37%	2.58%	-0.18%

Barclays Global Aggregate Index,是 Barclays 债券系列指数之一,用以衡量全球主要债务资产的表现,被全球资产管理公司广泛采用。本基金主要投资于全球债券市场,综合考虑本基金的投向与市场指数代表性等因素,选取 Barclay Global Aggregate Index 作为本基金的投资业绩评价基准。

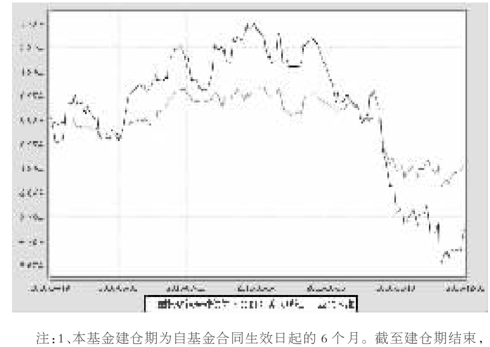
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银全球债券精选证券投资基金
自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016 年 4 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日)

1、国投瑞银全球债券(QDII)人民币



2、国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇



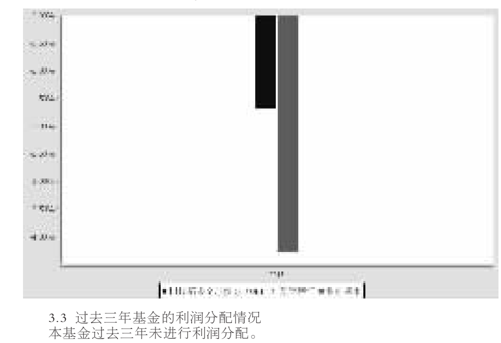
注:1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 19 日。至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银全球债券精选证券投资基金
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图
1、国投瑞银全球债券(QDII)人民币

2、国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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 2016 年 12 月底,在公募基金方面,公司共管理 63 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、期货套利、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		
颜文浩	本基金基金经理	2016-04-19	-	7	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2010 年 10 月加入国投瑞银。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和国投瑞银顺鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银全球债券精选证券投资基金(QDII-FOF)》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 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度,并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则:

1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时,坚持基金持有人利益优先;

2、当不同资产委托人利益发生冲突时,应公平的对待不同的资产委托人;

3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合;

4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下:

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程,提高投资管理的科学性和客观性,确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动,同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系,加强交易分配的内部控制,通过严格的制度、流程、技术手段保证公平交易原则的实现,同时通过监察稽核,事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下:

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统,充分发挥系统的自动控制功能,根据公平交易管理的要求,在系统中设置相应业务流转顺序、控制阀值或者触发机制,对触及阀值的行为视情况分别采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务自动执行必要的后续流程。如:符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易,内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理,控制阀值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动,通过建立明确的业务规则和流程,在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制,通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求,实现对关键业务的控制。如:以公司名义进行的一级市场申购结果分配,需要经过严格的公平性审核,由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后才为有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位,分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控,并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况,监督督促公平交易制度的执行。如:交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督,监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核,监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析,发现控制薄弱环节或交易价差异常,将重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制,针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中,披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明,接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查,公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时,将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况,并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题,也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式,也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析,并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为,将依法采取相关监管措施。

4.3.2 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。

报告期内,管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下:

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析,对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行 T 检验,检验在 95%的可信水平下,价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较,区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的交易情况。

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算,检查在过去四个季度内,是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示,公司管理的所有投资组合,在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 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

2016 年初美国经济增速仍较为疲软,非农数据低迷,就业数据持续走低,债券市场收益率震荡下行,美联储持续有加息预期但受制于经济基本面,迟迟没有靴子落地;6 月份英国脱欧进一步触发做多情绪,美国 10 年期国债在 6 月底创下新低到 1.45%,整体收益率曲线平坦化。在特朗普 10 月赢得美国大选等一系列利空因素影响下,债券收益率大幅上升,10 年美国国债最高调整至 2.6%附近。人民币在 2016 年持续贬值,市场预期较强,外汇占款持续流出,受迫与此,央行货币政策四季度开始收缩,国内资金价格上升。整体来看,美元债券在 2016 年震荡为主,部分债基出现负收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本期内,本基金人民币份额净值增长率为 5.40% ,美元份额净值增长率为 -1.70%,业绩比较基准收益率为 -4.28%。XXXXXXX

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,需关注特朗普上台后的政策与实施情况,目前市场观望情绪较浓;美国 CPI 持续走高,整体基建会否发力,或成为债券的一大阻力,整体对债市偏谨慎。

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、基金经理或其他投资组合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,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

国投瑞银全球债券(QDII)人民币本期已实现收益 2,475,086.28 元,期末可供分配利润为 1,851,205.20 元;国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇本期已实现收益 2,736,066.59 元;期末可供分配利润为 3,094,967.62 元。

本基金本报告期未进行收益分配。

§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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在国投瑞银全球债券精选证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 陈玲 陈遛迤签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20346 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国投瑞银全球债券精选证券投资基金
报告截止日:2016 年 12 月 31 日
单位:人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产:	-
银行存款	20,192,862.96
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	150,964,812.93
其中:股票投资	-
基金投资	150,964,812.93
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	785.79
应收股利	480,348.54
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	171,638,810.22
负债和所有者权益	本期末 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	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	348,799.15
应付管理人报酬	135,531.03
应付托管费	42,165.22
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	140,000.00
负债合计	666,495.40
所有者权益:	-
实收基金	161,669,477.85
未分配利润	9,302,836.97
所有者权益合计	170,972,314.82
负债和所有者权益总计	171,638,810.22

注:1、截止本报告期末,"国投瑞银全球债券(QDII)人民币"份额净值为人民币 1.054 元,基金份额 68,901,317.49 份;"国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇"份额净值美元 0.983 元,基金份额 14,422,986.13 份。

2、本基金合同生效日为 2016 年 4 月 19 日,2016 年度实际报告期间为 2016 年 4 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体:国投瑞银全球债券精选证券投资基金
本报告期:2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
单位:人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	11,671,399.71
1.利息收入	292,700.26
其中:存款利息收入	292,700.26
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	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,529,002.83
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	1,540,819.85
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	1,988,182.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,355,569.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	3,493,282.28
5.其他收入(损失以"-"号填列)	844.68
减:二、费用	2,104,677.18
1. 管理人报酬	1,270,369.89
2. 托管费	395,226.08
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	293,151.33
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	145,929.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	9,566,722.53
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	9,566,722.53

注:本基金合同生效日为 2016 年 4 月 19 日,2016 年度实际报告期间为 2016 年 4 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国投瑞银全球债券精选证券投资基金
本报告期:2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
单位:人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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)	219,827,493.47	0.00	219,827,493.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,566,722.53	9,566,722.53
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)	-58,158,015.62	-263,885.56	-58,421,901.18
其中:1.基金申购款	52,256,003.43	1,993,914.61	54,249,918.04
2.基金赎回款	-110,414,019.05	-2,257,800.17	-112,671,819.22
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	161,669,477.85	9,302,836.97	170,972,314.82

注:本基金合同生效日为 2016 年 4 月 19 日,2016 年度实际报告期间为 2016 年 4 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国投瑞银全球债券精选证券投资基金(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]213 号《关于准予国投瑞银全球债券精选证券投资基金注册的批复》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《国投瑞银全球债券精选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,存续期间不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 220,083,210.27 元,由人民币 119,436,080.87 元和美元 15,506,120.88 元 (折算为等值人民币 100,647,129.40 元)构成,业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(2016)第 254 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银全球债券精选证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 19 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 220,150,033.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,823.11 份基金份额。基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金境内托管人为中国银行股份有限公司,基金境外托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国投瑞银全球债券精选证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可投资于下列金融产品或工具:已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的境外债券型及货币型公募基金(含债券型及货币型 ETF),银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购等固定收益类金融工具以及货币市场工具;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要求)。本基金不主动参与股票等权益类资产的投资,包括不直接从二级市场买入股票等权益类资产和权证,不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金的投资比例为:投资于境外的债券型交易型开放式指数基金(债券型 ETF)、主动管理的债券型公募基金、债券合计不低于本基金基金资产的 80%,本基金为基金中基金(FOF),投资于基金的部分不低于本基金基金资产的 60%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制,基金管理人可依据相关规定履行适当程序后相应调整本基金的投资比例上限规定。本基金的业绩比较基准为:Barclay Global Aggregate Index。

7.4.2 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 (以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银全球债券精选证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)起至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

人民币

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

基金投资在持有期间应取得的现金股利扣除代扣代缴的税费后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作,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。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司("中银香港")	境外资产托管人
国投泰康信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司("UBS AG")	基金管理人的股东
国投瑞银资本管理有限公司	基金管理人的子公司
国投瑞银资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8 本报告期的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,270,369.89
其中:支付销售机构的客户维护费	468,656.95

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 0.90%的年费率计提,每日计提,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×0.90%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	395,226.08

注:支付基金托管人中国银行的托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务费)按前一日基金资产净值 0.28%的年费率计提,每日计提,按月支付。

其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.28%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 2016 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,059,608.02	54,726.94
中银香港	19,133,254.94	-

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末,本基金持有外方股东 UBS AG 控股的 UBS Asset Management 管理的交易型开放式基金 UBS ETF BARCLAY US LIQ.CORP. 其公允价值为 16,536,466.87 元,占基金资产净值比例为 9.67%。基金管理人对上述投资履行了相应的关联交易审批程序,并符合《基金合同》及法律法规的相关规定。

7.4.9 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 2016 年 12 月 31 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 150,964,812.93 元,无属于第二层次以及第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2016 年 12 月 31 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)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	150,964,812.93	87.95
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,192,862.96	11.76
8	其他各项资产	481,134.33	0.28
9	合计	171,638,810.22	100.00

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益资产。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益资产。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益资产。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未持有权益资产。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES USD SHORT DUR CP BOND ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	30,145,453.35	17.63
2	ISHARES USD CORP BOND ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	25,583,428.47	14.96
3	ISHARES USD TIPS ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	18,963,354.12	11.09
4	ISHARES US AGGREGATE BOND ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	18,429,153.34	10.78
5	UBS ETF BARCLAY US LIQ. CORP.	ETF	交易型开放式	UBS Asset Management	16,536,466.87	9.67
6	ISHARES USD TREASURY BOND 1-3 ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	10,150,482.01	5.94
7	ISHARES EURO HY CORP BND	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	5,926,451.95	3.47
8	ISHARES USD HY CORP BOND ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	5,662,100.87	3.31
9	LYX USD 10Y INFL EXPECTATION	ETF	交易型开放式	Lyxor Intl Asset Management	5,501,412.41	3.22
10	ISHARES JPM USD EM BND ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	4,937,216.21	2.89

注:投资者欲了解本报告期末本基金投资的所有基金明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	480,348.54
4	应收利息	785.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	481,134.33

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有债券投资。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
国投瑞银全球债券(QDII)人民币	247	278,952.70	24,308,800.00	35.28%	44,592,517.49	64.72%
国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇	208	69,341.28	-	0.00%	14,422,986.13	100.00%
合计	455	183,130.34	24,308,800.00	29.17%	59,015,503.62	70.83%

9.2 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	国投瑞银全球债券(QDII)人民币	129,685.61	0.19%
	国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇	-	0.00%
	合计	129,685.61	0.16%

9.3 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	国投瑞银全球债券(QDII)人民币	0
	国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国投瑞银全球债券(QDII)人民币	0
	国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国投瑞银全球债券(QDII)人民币	国投瑞银全球债券(QDII)美元现汇
基金合同生效日(2016 年 4 月 19 日)基金份额总额	119,498,968.94	15,506,727.13
本报告期期初基金份额总额	119,498,968.94	15,506,727.13
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	47,758,175.09	672,868.93
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	98,355,826.54	1,756,609.93
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	68,901,317.49	14,422,986.13

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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重大人事变动如下:

1、自 2016 年 2 月 3 日起刘纯亮先生不再担任公司总经理、包爱丽女士不再担任公司副总经理。

2、自 2016 年 2 月 3 日起聘任王彬女士担任公司总经理,兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长、法定代表人。

3、自 2016 年 8 月 12 日起聘任储诚忠先生担任公司副总经理。

4、自 2016 年 12 月 17 日起袁野先生不再兼任国投瑞银资本管理有限公司副总经理。

上述人事变动均已按法律法规要求在指定媒体予以披露。

报告期内基金托管人重大人事变动如下:

2016 年 12 月,郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所,普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金连续提供审计服务 1 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 70,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
Goldman Sachs International	1	-	-	293,151.33	100.00%	-

11.7.2 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		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Goldman Sachs International	-	-	-	-	-	-	293,136,596.71	100.00%

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股票、债券、回购及权证交易。

3、本基金本报告期交易单元未发生变化。

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一七年三月二十八日