# 国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金(原国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金转型) 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:中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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。
国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金由国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 6 日转型而来。根据《国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金合同》的有关规定,2018 年 1 月 29 日至 2018 年 1 月 5 日本基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自 2018 年 1 月 6 日,国投瑞银瑞兴保本混合型证券投资基金转型为国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金,因此上表报告期间的结束日为 2018 年 1 月 5 日。
本基金在本报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.2.4.9.2 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 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300580 | 贝斯特 | 2017-09-15 | 重大事项停牌 | 21.74 | 2018-03-01 | 19.57 | 127,800.00 | 2,999,143.00 | 2,778,372.00 | - |

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.2.4.9.3.1 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。
6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
6.2.5 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 国投瑞银瑞兴灵活配置混合型证券投资基金
(报告期:2018 年 1 月 6 日 -2018 年 6 月 30 日)
7.1.1 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 | 27,815,710.25 | 80.41 |
| | 其中:股票 | 27,815,710.25 | 80.41 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,011,483.40 | 5.81 |
| | 其中:债券 | 2,011,483.40 | 5.81 |
| | 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 | 4,715,260.41 | 13.63 |
| 8 | 其他各项资产 | 49,472.46 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 34,591,926.52 | 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。
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
7.1.2.1 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 | 15,362,164.65 | 44.69 |
| D | 电力,热力,燃气及水生产和供应业 | 885,136.00 | 2.58 |
| E | 建筑业 | 962,379.60 | 2.80 |
| F | 批发和零售业 | 1,202,568.00 | 3.50 |
| 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 | 1,159,720.00 | 3.37 |
| J | 金融业 | 6,582,771.00 | 19.15 |
| K | 房地产业 | 754,380.00 | 2.19 |
| 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 | 906,591.00 | 2.64 |
| S | 综合 | - | - |
| T | 合计 | 27,815,710.25 | 80.92 |

7.1.2.2 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。
7.1.3 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 | 601288 | 农业银行 | 509,000.00 | 1,750,960.00 | 5.09 |
| 2 | 600398 | 海澜之家 | 124,500.00 | 1,586,130.00 | 4.61 |
| 3 | 000423 | 东阿阿胶 | 29,000.00 | 1,560,490.00 | 4.54 |
| 4 | 002236 | 大华股份 | 64,100.00 | 1,445,455.00 | 4.21 |
| 5 | 000999 | 华润三九 | 49,800.00 | 1,385,934.00 | 4.03 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 79,500.00 | 1,317,315.00 | 3.83 |
| 7 | 601336 | 新华保险 | 28,400.00 | 1,217,792.00 | 3.54 |
| 8 | 603368 | 柳药股份 | 35,600.00 | 1,202,568.00 | 3.50 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 73,400.00 | 1,159,720.00 | 3.37 |
| 10 | 600132 | 重庆啤酒 | 38,400.00 | 1,063,296.00 | 3.09 |
| 11 | 000895 | 双汇发展 | 39,460.00 | 1,042,138.60 | 3.03 |
| 12 | 600535 | 天士力 | 40,240.00 | 1,038,996.80 | 3.02 |
| 13 | 600104 | 上汽集团 | 29,100.00 | 1,018,209.00 | 2.96 |
| 14 | 002032 | 苏泊尔 | 19,700.00 | 1,014,550.00 | 2.95 |
| 15 | 002191 | 劲嘉股份 | 132,570.00 | 990,297.90 | 2.88 |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 176,260.00 | 962,379.60 | 2.80 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 32,500.00 | 906,750.00 | 2.64 |
| 18 | 002343 | 慈文传媒 | 48,300.00 | 906,591.00 | 2.64 |
| 19 | 600027 | 华电国际 | 225,800.00 | 885,136.00 | 2.58 |
| 20 | 600019 | 宝钢股份 | 108,100.00 | 842,099.00 | 2.45 |
| 21 | 601318 | 中国平安 | 13,900.00 | 814,262.00 | 2.37 |
| 22 | 002223 | 鱼跃医疗 | 39,215.00 | 764,300.35 | 2.22 |
| 23 | 601818 | 光大银行 | 207,100.00 | 757,986.00 | 2.21 |
| 24 | 001979 | 招商蛇口 | 39,600.00 | 754,380.00 | 2.19 |
| 25 | 600036 | 招商银行 | 27,400.00 | 724,456.00 | 2.11 |
| 26 | 603899 | 晨光文具 | 22,200.00 | 703,518.00 | 2.05 |

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601288 | 农业银行 | 2,275,230.00 | 6.62 |
| 2 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,273,440.00 | 6.61 |
| 3 | 601336 | 新华保险 | 1,705,418.00 | 4.96 |
| 4 | 002048 | 宁波华翔 | 1,705,217.00 | 4.96 |
| 5 | 000895 | 双汇发展 | 1,705,048.69 | 4.96 |
| 6 | 000999 | 华润三九 | 1,704,768.52 | 4.96 |
| 7 | 002223 | 鱼跃医疗 | 1,704,568.50 | 4.96 |
| 8 | 600406 | 国电南瑞 | 1,704,560.00 | 4.96 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 1,704,461.00 | 4.96 |
| 10 | 002236 | 大华股份 | 1,704,088.00 | 4.96 |
| 11 | 600398 | 海澜之家 | 1,514,690.00 | 4.41 |
| 12 | 601668 | 中国建筑 | 1,252,246.00 | 3.64 |
| 13 | 603368 | 柳药股份 | 1,240,703.72 | 3.61 |
| 14 | 601098 | 中南传媒 | 1,137,301.00 | 3.31 |
| 15 | 600019 | 宝钢股份 | 1,137,210.00 | 3.31 |
| 16 | 600535 | 天士力 | 1,136,795.00 | 3.31 |
| 17 | 000501 | 鄂武商 A | 1,136,571.00 | 3.31 |
| 18 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,136,537.60 | 3.31 |
| 19 | 600104 | 上汽集团 | 1,136,520.00 | 3.31 |
| 20 | 002343 | 慈文传媒 | 1,135,596.00 | 3.30 |

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。
7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300580 | 贝斯特 | 2,501,046.00 | 7.28 |
| 2 | 002048 | 宁波华翔 | 1,220,806.00 | 3.55 |
| 3 | 601098 | 中南传媒 | 1,050,833.00 | 3.06 |
| 4 | 000501 | 鄂武商 A | 995,355.00 | 2.90 |
| 5 | 600138 | 中青旅 | 984,425.00 | 2.86 |
| 6 | 603658 | 安图生物 | 785,231.00 | 2.28 |
| 7 | 002223 | 鱼跃医疗 | 783,608.00 | 2.28 |
| 8 | 000895 | 双汇发展 | 573,884.40 | 1.67 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 470,028.00 | 1.37 |
| 10 | 600132 | 重庆啤酒 | 423,470.00 | 1.23 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 401,230.80 | 1.17 |
| 12 | 002241 | 歌尔股份 | 400,561.41 | 1.17 |
| 13 | 000999 | 华润三九 | 386,522.00 | 1.12 |
| 14 | 000423 | 东阿阿胶 | 341,562.00 | 0.99 |
| 15 | 002032 | 苏泊尔 | 317,124.00 | 0.92 |
| 16 | 601818 | 光大银行 | 245,650.00 | 0.71 |
| 17 | 603899 | 晨光文具 | 229,473.00 | 0.67 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 139,659.00 | 0.41 |
| 19 | 600535 | 天士力 | 105,748.00 | 0.31 |

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。
7.1.4.3 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 | 41,363,556.48 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 12,356,216.61 |

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。
7.1.5 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 2,011,483.40 | 5.85 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,011,483.40 | 5.85 |

7.1.6 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

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 | 113013 | 国君转债 | 10,240 | 1,037,414.40 | 3.02 |
| 2 | 113009 | 广汽转债 | 9,770 | 974,069.00 | 2.83 |

注:本基金本报告期末仅持有以上债券。
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
7.1.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.1.10.1 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。
7.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货等金融衍生品。本基金利用股指期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.1.11.1 本期国债期货投资政策
为更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用国债期货等金融衍生品。本基金利用国债期货合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,提高投资组合的运作效率。
7.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。
7.1.12 投资组合报告附注
7.1.12.1 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。
7.1.12.2 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。
7.1.12.3 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 | 20,750.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,429.71 |
| 5 | 应收申购款 | 1,291.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 49,472.46 |

(下转 B439 版)