

国投瑞银信息消费灵活配置混合型证券投资基金 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

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基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要请自半年度报告正文，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 国投瑞银信息消费基金

基金代码 000845

交易代码 000845

运作方式 约定开放式

基金经理 2014/12/31

基金类型 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 112,578,744份

报告期末基金资产净值 不适用

2.2 基金产品说明

本基金在严格控制风险的前提下，通过投资于信息技术、通信设备、消费电子、医药、互联网、节能环保、新能源、新材料、高端装备、先进制造、消费升级等高景气度的行业，精选具有持续竞争优势的优质企业，力争在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

（一）基金产品特征

本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金，但低于股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种。

（二）投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，通过投资于信息技术、通信设备、消费电子、医药、互联网、节能环保、新能源、新材料、高端装备、先进制造、消费升级等高景气度的行业，精选具有持续竞争优势的优质企业，力争在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

（三）投资范围

本基金的投资范围主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、央行票据、短期融资券、企业债、公司债、可转债（含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）、资产支持证券、债券回购、银行存款和货币市场工具、股指期货、期权以及法律法规允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的有关规定）。

（四）投资策略

本基金将通过深入研究，精选具有持续竞争优势的优质企业，力争在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

（五）业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×60%+中债总财富指数收益率×40%

风险收益特征 本基金为高仓位基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于股票型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

名称 国投瑞银基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 王彬

性别 男

联系电话 400-880-6888 010-65949696

电子邮箱 service@ubsci.com fcid@bankin.com

客户服务电话 400-880-6888 95566

传真 0755-8294048 010-65949492

2.4 信息披露方式

基金半年度报告通常由基金管理人互联网网址 http://www.ubsci.com

基金半年度报告备置地 深圳市福田区金田路 4028 号深纺设计中心 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 财务报告

报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

本报告期已实现收益 -915,960.93

本期利润 -15,752,839.0

加权平均基金份额利润 -0.1532

本期基金份额净值 1.138%

3.1.2 财务报告

报告期：2018年 6月 30日

期末基金份额净值 0.0744

基金期末净值 -1.074

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，即期末可供基金份额持有人分配的利润，采用期末可供分配利润除以期末基金份额总数的金额。

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

报告期：2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

3.2.2 基金净值表现

报告期：2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

3.2.3 基金份额净值

报告期：2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

3.3 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，经中国证监会监督管理委员会批准，于 2002 年 5 月 13 日成立，注册资本 1 亿元人民币。公司是中国第一家境外机构设立的合资公司，公司股东为国投瑞银基金管理有限公司（国家开发投资公司控股子公司）及瑞士银行有限公司（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机制。截至 2018 年 6 月底，在公司基金方面，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 年获得客户资产管理业务资格以来，已成功运用专户产品满足了灵活配置型、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 从业年 期 说明

任日期 离任日期

王彬 基金经理 2018-01-06 - 5 中国国籍，具有证券投资经验，2013 年 10 月担任专户投资部总监，2016 年 4 月转任研究部，现任国投瑞银基金管理有限公司基金经理。2016 年 1 月，通过《中国证券投资基金业协会基金评价委员会关于对基金经理评价的函》，因投资管理能力突出，被评价为“评价优秀”基金经理。2017 年 1 月，通过《中国证券投资基金业协会基金评价委员会关于对基金经理评价的函》，因投资管理能力突出，被评价为“评价优秀”基金经理。2018 年 1 月，通过《中国证券投资基金业协会基金评价委员会关于对基金经理评价的函》，因投资管理能力突出，被评价为“评价优秀”基金经理。

陈小玲 基金经理 2014-12-03 2018-01-16 13 中国国籍，具有证券投资经验，曾任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（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证监会监督管理委员会批准，于 2002 年 5 月 13 日成立，注册资本 1 亿元人民币。公司是中国第一家境外机构设立的合资公司，公司股东为国投瑞银基金管理有限公司（国家开发投资公司控股子公司）及瑞士银行有限公司（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机制。截至 2018 年 6 月底，在公司基金方面，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 年获得客户资产管理业务资格以来，已成功运用专户产品满足了灵活配置型、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。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

在报告期间内，基金管理人遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其系

列规定，本着恪守诚信、审慎尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理好和运用基金资产。在报告期间内，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，确保本基金基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等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。本报告期内，本基金管理人各项公平交易制度流程得以良好地贯彻执行，未发现存在不公平交易情况。

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。

4.3.3 与关联方交易的专项说明

本基金于本报告期内未出现参与交易所公开竞价、与关联方达成协议购买或出售证券的情况。

4.3.4 投资偏离度的专项说明

本基金于本报告期内未出现偏离度绝对值在 0.5%以上的交易日。

4.3.5 其他

4.4 管理人对报告期内基金投资组合的重大变化的说明

4.4.1 本报告期内基金投资组合的重大变化

报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

4.4.2 投资组合报告

报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

4.6 管理人对基金未来业绩的展望

报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

所有者权益 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日

4.7 管理人对会计师事务所的说明

报告期：2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

单位：人民币元

资产 本期末 上年度末

负债 2018年 6月 30日 2017年 12月 31日</