

## 国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)

## 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

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确认，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 基金基本情况

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银新兴市场精选(ODI-LOF)
场内简称	国投新兴
基金代码	161210
交易代码	161210
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月10日
基金托管人	国投瑞银基金管理有限公司
基金合同存续期	不固定
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年7月1日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球新兴市场国家或地区的股票，通过对投资对象的精选和组合投资，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。
本基金投资于世界或中国新兴市场国家或地区的股票，主要投资于新兴市场国家或地区的“自主品牌”企业，即企业的营业收入或利润的至少50%来自该国或地区的营业收入或利润。	本基金主要投资于全球新兴市场国家或地区的股票，主要投资于新兴市场国家或地区的“自主品牌”企业，即企业的营业收入或利润的至少50%来自该国或地区的营业收入或利润。
本基金主要投资于全球新兴市场国家或地区的股票，主要投资于新兴市场国家或地区的“自主品牌”企业，即企业的营业收入或利润的至少50%来自该国或地区的营业收入或利润。	本基金主要投资于全球新兴市场国家或地区的股票，主要投资于新兴市场国家或地区的“自主品牌”企业，即企业的营业收入或利润的至少50%来自该国或地区的营业收入或利润。
业绩比较基准	摩根士丹利资本国际新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index Net Total Return)。
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金品种。本基金投资于新兴市场国家或地区的股票，风险相对较高，但预期收益也相对较高。本基金主要投资于新兴市场国家或地区的证券，因此有较大的新兴市场投资所面临的风险特征。

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
英文名称	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited	
信息披露负责人姓名	刘强	严明
信息披露负责人证件	400-880-6888	010-65015798
信息披露负责人邮箱	service@baxi.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-880-6888	95588
传真	0755-82040448	010-66105799

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	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited	
英文名称	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited	
注册地址	香港中环德忌利士街4A号渣打大厦十二楼	
办公地址	香港九龙,官涌,荷李活道388号,渣打中心十五	
邮政编码		

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露名称	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》
信息披露年度报告全文的管理人互联网网址	http://www.usbsec.com
基金年度报告备置地点	基金管理公司住所地4028号美银经贸中心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 基本数据和指标	报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日
本期已实现收益	1,990,447.14
本期利润	-771,0755
加权平均基金份额本期利润	-0.0301
期末基金份额净值	-3.07%
3.1.2 基本数据和指标	报告期: 2018年6月30日

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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之和减去本期的孰低数,为期末余额,不是当期发生数)。

3.以上所列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),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

单位:百分比

3.2.2 基金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的历史走势对比图

(2010年6月10日至2018年6月30日)

注:本基金建仓期为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。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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2006年5月13日成立,注册资本1亿元人民币。公司是全国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司,公司股东为国投康泰控股(国家)开发投资公司的控股子公司)及瑞士银行控股有限公司(UBS AG)。公司拥有完善的企业法人治理结构,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,已成功运作管理的客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、指基策略、商品期货、ODI等创新产品,在境内外资产管理业务方面,公司自2006年开始为QFII计划提供投资咨询服务,具有丰富经验,并于2007年获得ODI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 任期从 任期至 说明

姓名	职务	任期从	任期至	说明
范海波	基金经理	2012-03-10	-	19.中国籍,硕士,具有基金从业资格。美国银行金融分析师(CFA),中国银行理财师(CFP),证券投资分析师(LOF),证券投资分析师(基金),证券投资分析师(基金合同)等有关规定持有人利益管理及控制架构,本报告期未对基金运作产生重大影响。

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 增资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 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《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)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,使基金份额持有人的利益得到保护。基金资产投资于股票,在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.4.2 同一交易日反向交易成交较少的双边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况

4.4.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明

4.5 管理人对报告期内基金投资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《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)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,使基金份额持有人的利益得到保护。基金资产投资于股票,在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.6 管理人对报告期内基金投资组合的说明

4.6.1 公平交易制度的执行情况

在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.6.2 同一交易日反向交易成交较少的双边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况

4.6.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明

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《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)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,使基金份额持有人的利益得到保护。基金资产投资于股票,在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.7 管理人对报告期内基金投资组合的说明

4.7.1 公平交易制度的执行情况

在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.7.2 同一交易日反向交易成交较少的双边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况

4.7.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明

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《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)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,使基金份额持有人的利益得到保护。基金资产投资于股票,在报告期内,本基金管理人通过制度、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、交易执行等方面均得到公平对待,通过公平交易行为的监控、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,本基金管理人在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現象。

4.8 管理人对报告期内基金投资组合的说明

4.8.1 公司管理的其他基金

4.8.2 公司管理的其他基金的净值表现

4.8.3 公司管理的其他基金的净值表现

4.8.4 公司管理的其他基金的净值表现

4.8.5 公司管理的其他基金的净值表现

</