

国投瑞银创新动力混合型证券投资基金

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：中国光大银行股份有限公司
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、监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、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。

基金管理人中国光大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。

本报告书财务资料未经审计。

本报告书自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	国投瑞银创新动力基金
基金主代码	121005
交易代码	121005(场内) 128005(场外)
基金运作方式	契约型开放式
基金经理	国投瑞银基金管理有限公司 中国光大银行股份有限公司
定期报告期末基金资产总额	1,630,252,884.65
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金将坚持价值投资，分享企业带来的超额回报，实现股东价值的最大化。

投资策略 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财务复核岗复核估值结果，最终由估值核算岗与产品托管人的估值结果核对一致。

1. 估值原则及程序 60%—95%；

(2) 为股票型基金，其股票投资比例范围为50%—100%；其中现金及到期日一年以内政府债券投资不高于5%。

2. 估值方法

本基金的估值方法遵循以下原则：(1)对于证券交易所上市的股票、债券和权证，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；

(2)对于在证券交易所上市的债券，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(3)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(4)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(5)对于在证券交易所上市的基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；

(6)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(7)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(8)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(9)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(10)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(11)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(12)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(13)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(14)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(15)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(16)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(17)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(18)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(19)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(20)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(21)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(22)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(23)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(24)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(25)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(26)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(27)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(28)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(29)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(30)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(31)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(32)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(33)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(34)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(35)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(36)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(37)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(38)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(39)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(40)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(41)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(42)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(43)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(44)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(45)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(46)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(47)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(48)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(49)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(50)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(51)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(52)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(53)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(54)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(55)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(56)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(57)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(58)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(59)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(60)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(61)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(62)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(63)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(64)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(65)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(66)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(67)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(68)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(69)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(70)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(71)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(72)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(73)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(74)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(75)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(76)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(77)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(78)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(79)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(80)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(81)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(82)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(83)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(84)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(85)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(86)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(87)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(88)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(89)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(90)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(91)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(92)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(93)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(94)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(95)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(96)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；

(97)对于在证券交易所上市的债券回购，按估值日收盘价减去债券的交易费用后的余额作为估值金额；

(98)对于在证券交易所上市的权证，按估值日收盘价减去权证的交易费用后的余额作为估值金额；