

国投瑞银瑞宁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、基金托管人、基金份额持有人应当遵守基金合同，恪守职业道德，遵守法律法规和行业规范，诚实守信、勤勉尽责地履行各自的职责，维护基金份额持有人的合法权益。
本基金由国投瑞银基金管理有限公司担任基金管理人，由国投瑞银基金管理有限公司担任基金托管人。国投瑞银基金管理有限公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。
本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场的波动而发生波动。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩的保证。
基金合同自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银瑞宁混合
基金代码	028311
交易代码	028311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月13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
基金类型	混合型
基金规模	61,304,564.01份
基金总资产	人民币元

2.2 基金产品说明

基金投资范围：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转换债券）、可交换债券、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、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会关于基金投资比例的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为0%~95%，投资于现金类资产的比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。

4.6 管理费按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估值委员会、运营部及相关部门。

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业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，通过估值核算人员及时与基金经理沟通协调，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送估值委员会综合考虑投资部、研究部、运营部等各方面的情况和意见，并按照有关规定审议讨论通过，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部根据经估值委员会审议并通过的特别估值调整意见执行估值调整，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

4.6.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的情况

本基金报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中指数据有限公司建立了业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流动性风险评估报告。

4.6.4 报告期间内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为-915,971.50元，期末可供分配利润为1,246,263.93元。

本基金报告期基本情况进行收益分配。

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

本基金报告期内，中国银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在国投瑞银灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“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

本基金报告期内，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在操作基金资产方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金报告期内的财务状况、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：

5.4 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

11.1 初期投资损失

本期初至报告期期末的损益变动

本期末

-25,347.12

-10,029

-3.59%

11.2 投资损失

本期初至报告期期末的损益变动

本期末

-102

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）扣除除费用后的余额，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乘以期末基金份额净值的孰低者，而不是当期发生。

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：人民币元

11.1 本期份额净值

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

11.2 同期业绩比较基准

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

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）扣除除费用后的余额，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乘以期末基金份额净值的孰低者，而不是当期发生。

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将低于所列数字。

3.2.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位：人民币元

11.1 本期份额净值

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

11.2 同期业绩比较基准

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

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）扣除除费用后的余额，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乘以期末基金份额净值的孰低者，而不是当期发生。

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将低于所列数字。

3.2.3 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位：人民币元

11.1 本期份额净值

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

11.2 同期业绩比较基准

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

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）扣除除费用后的余额，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乘以期末基金份额净值的孰低者，而不是当期发生。

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将低于所列数字。

3.2.4 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位：人民币元

11.1 本期份额净值

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

11.2 同期业绩比较基准

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

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）扣除除费用后的余额，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乘以期末基金份额净值的孰低者，而不是当期发生。

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将低于所列数字。

3.2.5 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位：人民币元

11.1 本期份额净值

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

11.2 同期业绩比较基准

报告期初至报告期期末的损益变动

报告期末

-95.07%

-25,347.12

-10,029

-3.59%

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）扣除除费用后的余额，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乘以期末基金份额净值的孰低者，而不是当期发生。

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将低于所列数字。

3.2.6 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位：人民币元