

# 国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金 (原国投瑞银新活力灵活配置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:渤海银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为,并勤勉尽责地履行了法定职责。本基金的名称、基金简称、基金代码等基本信息未发生变更,并持续符合法律法规、基金合同及招募说明书的有关规定。

基金合同由国投瑞银新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同(以下简称“基金合同”)和《国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金基金合同的规则》(以下简称“基金合同规则”)组成,二者不可分割,基金合同是基金合同规则的组成部分,二者共同构成基金合同。

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表明未来表现,投资人在购买基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。

国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金由国投瑞银新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同于2017年12月20日至2018年1月22日15:00期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议了《关于同意国投瑞银新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同变更为国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金基金合同的议案》,该议案于2018年1月22日经基金份额持有人大会表决通过,自2018年3月6日起生效,因此,上表报告期间的起始日为2018年3月6日。截至本报告期末基金转型合同生效未满一年。

本基金业绩比较基准为:沪深300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.1.2 自基金转型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变动的比较

国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2018年3月6日至2018年6月30日)

国投瑞银新活力混合C

数据来源:基金定期报告,未经审计。

本报告中国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金的份额净值起至2018年3月6日止,国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金的份额净值起至2018年6月30日止。

相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及本公司网站。

本半年度报告摘要由基金管理人负责编制,未经审计,请予以关注。

2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金

基金名称	国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银新活力混合
基金代码	001504
交易代码	001504
基金运作方式	契约型,以定期开放式运作
基金合同生效日	2018年3月6日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	189,776,120.81份
基金合同存续期间	不定期

下属分级基金的基金简称

国投瑞银新活力混合A 国投瑞银新活力混合C

下属分级基金的交易代码

001504 001505

报告期末下属分级基金的份额总额

19,144,640份 189,776,120.81份

2.2 国投瑞银新活力灵活配置混合型证券投资基金

2.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

报告期数据和指标	报告期2018年1月1日至2018年3月6日
本期已实现收益	1205 -13,023.88
本期利润	1205 -13,023.88
加权平均基金份额本期利润	0.0169 0.0166
本期平均净值利润率	1.46% 1.43%
本期基金份额净增长率	1.11% 0.00%

报告期数据和指标

国投瑞银新活力混合A 国投瑞银新活力混合C

下属分级基金的基金简称

国投瑞银新活力混合A 国投瑞银新活力混合C

下属分级基金的交易代码

001504 001505

报告期末下属分级基金的份额总额

47,833,265份 160,656,067,500份

2.2.2 基金产品说明

2.2.1 国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金

投资目标

在严格控制风险的基础上,通过对不同资产类别的优化配置及组合操作,力争在风险调整后的收益方面取得超越市场的收益,力求实现基金资产的长期稳定增长。

基金的投资范围

本基金主要投资于国内依法设立、合法存续的股票、债券、货币市场工具、基金、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、商品期货、期权、权证及其他金融衍生品,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资策略

本基金将通过深入行业配置研究,运用货币市场工具的配置策略,并管理好仓位。

2.优待股投资策略

本基金将根据上市公司的盈利能力、股息率、市盈率等指标,精选出具有投资价值的优待股,并择机买入。

3.债券投资策略

本基金将根据宏观经济形势、利率水平、信用利差等因素,通过久期策略、期限策略、信用策略等,选择具有投资价值的债券品种。

4.衍生品投资策略

本基金将根据法律法规的规定,结合基金的风险收益特征,审慎地进行衍生品投资。

5.股票投资策略

本基金将根据宏观经济形势、行业景气度、估值水平、公司基本面分析、行业配置策略,精选出具有投资价值的股票品种。

6.权证投资策略

本基金将根据权证的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的权证品种。

7.国债期货及股指期货投资策略

本基金将根据国债期货和股指期货的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的国债期货和股指期货品种。

8.商品期货及期权投资策略

本基金将根据商品期货和期权的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的商品期货和期权品种。

9.资产支持证券投资策略

本基金将根据资产支持证券的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的资产支持证券品种。

10.股指期货投资策略

本基金将根据股指期货的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的股指期货品种。

11.商品期货及期权投资策略

本基金将根据商品期货和期权的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的商品期货和期权品种。

12.权证投资策略

本基金将根据权证的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的权证品种。

13.国债期货及股指期货投资策略

本基金将根据国债期货和股指期货的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的国债期货和股指期货品种。

14.商品期货及期权投资策略

本基金将根据商品期货和期权的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的商品期货和期权品种。

15.资产支持证券投资策略

本基金将根据资产支持证券的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的资产支持证券品种。

16.股指期货投资策略

本基金将根据股指期货的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的股指期货品种。

17.商品期货及期权投资策略

本基金将根据商品期货和期权的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的商品期货和期权品种。

18.权证投资策略

本基金将根据权证的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的权证品种。

19.国债期货及股指期货投资策略

本基金将根据国债期货和股指期货的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的国债期货和股指期货品种。

20.商品期货及期权投资策略

本基金将根据商品期货和期权的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的商品期货和期权品种。

21.权证投资策略

本基金将根据权证的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的权证品种。

22.国债期货及股指期货投资策略

本基金将根据国债期货和股指期货的定价模型,结合宏观经济形势、行业配置策略,精选出具有投资价值的国债期货和股指期货品种。

23.基金管理制度人及基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

国投瑞银基金管理有限公司 渤海银行股份有限公司

姓名 刘斌 阮伟

联系电话 400-890-6968 010-66270109

电子邮箱 service@ubcfc.com jianuan@ubcfc.com

客户服务电话 400-890-6968 4009888100/95541

传真 0755-29000408 022-56314791

注册地址 上海虹桥路1号东方品质广场B座11层 中国天府大道99号成都东部新区天府国际中心218号

办公地址 深圳市福田区福华路4028号深业上城中心46层

邮政编码 518035 300012

法定代表人 叶帆舟 李伏安

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称:《证券时报》、《中国证券报》

登载半年度报告正文的互联网址: http://www.ubcfc.com

基金年度报告发布地点: 深圳市福田区金田路4028号深业上城超高层中心46层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

报告期数据和指标 报告期2018年1月1日至2018年3月6日

本期已实现收益 683,000 3,274,517.75

本期利润 686,011 3,379,024.08

加权平均基金份额本期利润 0.0169 0.0166

本期平均净值利润率 1.46% 1.43%

本期基金份额净增长率 1.48% 1.46%

报告期数据和指标 报告期2018年1月1日至2018年3月6日

本期可供分配利润 -986,008 -10,542,158.33

本期利润 -0.0444 -0.0566

本期基金份额净值 21,669.71 20,996,862.22

本期基金份额净值 -1,0102 1,0968

报告期数据和指标 报告期2018年1月1日至2018年3月6日

国投瑞银新活力混合A 国投瑞银新活力混合C

基金份额计净值增长率 1.48% 1.46%

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,采用期末资产负债表中未分配利润表中未分配部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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上述数字。

4.国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金由国投瑞银新活力定期开放混合型证券投资基金于2018年3月6日转型而成。本基金对应的本期基金份额净值增长率及基金份额累计净值增长率的计算起始日为本基金转型起始日2018年3月6日。截至本报告期末

本基金合同生效未满一年。

5.2.1 基金净值表现

5.2.1.1 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