

信息披露 disclosure

国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月20日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。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 基金经理或基金经理小组简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table with columns: Name, Position, Start Date, End Date, Years of Experience, Remarks. Lists fund managers and their qualifications.

注:任职日期和离任日期均以公司公告为准。注:证券从业年限指从事证券行业的工作年限,包括在证券公司、基金管理公司、信托投资公司、证券资产管理公司、证券投资咨询公司、期货资产管理公司、保险资产管理公司、证券投资咨询机构、证券资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所、证券监管机构、证券交易所、证券业协会、证券自律组织、证券服务机构等单位从事证券业务的时间。

注:任职日期和离任日期均以公司公告为准。注:证券从业年限指从事证券行业的工作年限,包括在证券公司、基金管理公司、信托投资公司、证券资产管理公司、证券投资咨询公司、期货资产管理公司、保险资产管理公司、证券投资咨询机构、证券资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所、证券监管机构、证券交易所、证券业协会、证券自律组织、证券服务机构等单位从事证券业务的时间。

4.2 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《国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金合同》等相关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产,在报告期内,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的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

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。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略及运作分析

到2018年第三季度,经济数据显示经济韧性依然很强,但信用收缩和中美贸易摩擦使得市场对未来的经济预期非常谨慎。过去几期的房地产价格上涨以及地方债务的增长使得市场对未来中期经济走势相对谨慎,市场对未来经济和社会走势变化相比预期升级,因此,虽然目前经济韧性较强,股债持续震荡走弱。三季度,本基金适度配置债券类资产,权益资产保持中性偏低的仓位,阶段性进行了仓位调整,持仓主要分布于金融、消费行业和新能源车等行业。

4.2 报告期内基金的投资表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.032元,本报告期份额净值增长率-2.82%,同期业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内本基金曾出现过连续二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,至本报告期末(9月30日)已高于5000万元,基金管理人依据相关规定在本公告中进行披露,提醒基金份额持有人关注。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing the fund's asset composition at the end of the reporting period, including categories like Equity Securities, Bonds, and Cash.

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing the fund's stock investment portfolio categorized by industry at the end of the reporting period.

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

Table showing the top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

Table showing the top 10 bonds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

Table showing the top 10 asset-backed investments held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

5.11 报告期末本基金投资的场外期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有场外期权。

5.12 报告期末本基金投资的银行理财产品交易情况说明

本基金本报告期末未持有银行理财产品。

5.13 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资

Table showing the top 10 funds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品。

5.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.18 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

5.19 报告期末本基金投资的场外期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有场外期权。

5.20 报告期末本基金投资的银行理财产品交易情况说明

本基金本报告期末未持有银行理财产品。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资

Table showing the top 10 funds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有基金。

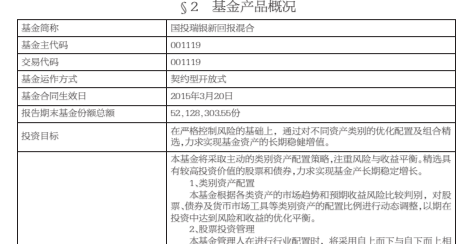
5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品。

国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月20日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。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 基金经理或基金经理小组简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table with columns: Name, Position, Start Date, End Date, Years of Experience, Remarks. Lists fund managers and their qualifications.

注:任职日期和离任日期均以公司公告为准。注:证券从业年限指从事证券行业的工作年限,包括在证券公司、基金管理公司、信托投资公司、证券资产管理公司、证券投资咨询公司、期货资产管理公司、保险资产管理公司、证券投资咨询机构、证券资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所、证券监管机构、证券交易所、证券业协会、证券自律组织、证券服务机构等单位从事证券业务的时间。

注:任职日期和离任日期均以公司公告为准。注:证券从业年限指从事证券行业的工作年限,包括在证券公司、基金管理公司、信托投资公司、证券资产管理公司、证券投资咨询公司、期货资产管理公司、保险资产管理公司、证券投资咨询机构、证券资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所、证券监管机构、证券交易所、证券业协会、证券自律组织、证券服务机构等单位从事证券业务的时间。

4.2 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《国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金合同》等相关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产,在报告期内,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的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

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。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略及运作分析

到2018年第三季度,经济数据显示经济韧性依然很强,但信用收缩和中美贸易摩擦使得市场对未来的经济预期非常谨慎。过去几期的房地产价格上涨以及地方债务的增长使得市场对未来中期经济走势相对谨慎,市场对未来经济和社会走势变化相比预期升级,因此,虽然目前经济韧性较强,股债持续震荡走弱。三季度,本基金适度配置债券类资产,权益资产保持中性偏低的仓位,阶段性进行了仓位调整,持仓主要分布于金融、消费行业和新能源车等行业。

4.2 报告期内基金的投资表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.032元,本报告期份额净值增长率-2.82%,同期业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内本基金曾出现过连续二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,至本报告期末(9月30日)已高于5000万元,基金管理人依据相关规定在本公告中进行披露,提醒基金份额持有人关注。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing the fund's asset composition at the end of the reporting period, including categories like Equity Securities, Bonds, and Cash.

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing the fund's stock investment portfolio categorized by industry at the end of the reporting period.

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

Table showing the top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

Table showing the top 10 bonds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

Table showing the top 10 asset-backed investments held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

5.11 报告期末本基金投资的场外期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有场外期权。

5.12 报告期末本基金投资的银行理财产品交易情况说明

本基金本报告期末未持有银行理财产品。

5.13 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资

Table showing the top 10 funds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品。

5.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.18 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

5.19 报告期末本基金投资的场外期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有场外期权。

5.20 报告期末本基金投资的银行理财产品交易情况说明

本基金本报告期末未持有银行理财产品。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资

Table showing the top 10 funds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品。

国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月19日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。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 基金经理或基金经理小组简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table with columns: Name, Position, Start Date, End Date, Years of Experience, Remarks. Lists fund managers and their qualifications.

注:任职日期和离任日期均以公司公告为准。注:证券从业年限指从事证券行业的工作年限,包括在证券公司、基金管理公司、信托投资公司、证券资产管理公司、证券投资咨询公司、期货资产管理公司、保险资产管理公司、证券投资咨询机构、证券资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所、证券监管机构、证券交易所、证券业协会、证券自律组织、证券服务机构等单位从事证券业务的时间。

注:任职日期和离任日期均以公司公告为准。注:证券从业年限指从事证券行业的工作年限,包括在证券公司、基金管理公司、信托投资公司、证券资产管理公司、证券投资咨询公司、期货资产管理公司、保险资产管理公司、证券投资咨询机构、证券资信评级机构、资产评估机构、会计师事务所、律师事务所、证券监管机构、证券交易所、证券业协会、证券自律组织、证券服务机构等单位从事证券业务的时间。

4.2 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《国投瑞银新增长灵活配置混合型证券投资基金合同》等相关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产,在报告期内,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的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

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。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略及运作分析

到2018年第三季度,经济数据显示经济韧性依然很强,但信用收缩和中美贸易摩擦使得市场对未来的经济预期非常谨慎。过去几期的房地产价格上涨以及地方债务的增长使得市场对未来中期经济走势相对谨慎,市场对未来经济和社会走势变化相比预期升级,因此,虽然目前经济韧性较强,股债持续震荡走弱。三季度,本基金适度配置债券类资产,权益资产保持中性偏低的仓位,阶段性进行了仓位调整,持仓主要分布于金融、消费行业和新能源车等行业。

4.2 报告期内基金的投资表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.1304元,本报告期份额净值增长率0.27%,同期业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内本基金曾出现过连续二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,至本报告期末(9月30日)已高于5000万元,基金管理人依据相关规定在本公告中进行披露,提醒基金份额持有人关注。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing the fund's asset composition at the end of the reporting period, including categories like Equity Securities, Bonds, and Cash.

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing the fund's stock investment portfolio categorized by industry at the end of the reporting period.

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

Table showing the top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

Table showing the top 10 bonds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

Table showing the top 10 asset-backed investments held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

5.11 报告期末本基金投资的场外期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有场外期权。

5.12 报告期末本基金投资的银行理财产品交易情况说明

本基金本报告期末未持有银行理财产品。

5.13 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资

Table showing the top 10 funds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品。

5.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.18 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

5.19 报告期末本基金投资的场外期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有场外期权。

5.20 报告期末本基金投资的银行理财产品交易情况说明

本基金本报告期末未持有银行理财产品。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资

Table showing the top 10 funds held by the fund at the end of the reporting period, ranked by fair value as a percentage of net asset value.

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品。

国投瑞银核心企业混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

国投瑞银核心企业混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年6月19日至2018