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:二〇一九年四月二十二日

金合同生效日 告期末基金份額总額

投资策略

业绩比较基准

【险收益特征

3.1 主要财务指标

2.本期利润

主要财务指标

费、基金转换费等), 计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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:二〇一九年四月二十二日

基金主代码 交易代码

2资目标

夏资策略

(绩比较基准

11险收益特征

3.1 主要财务指标

1.本期已实现收益 2.本期利润 3.加权平均基金份额 4.期末基金资产净值

主要财务指标

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人

3.1 主要财务指标

18日26日 - 18日2 - 181 - 181 - 181 - 181 - 18

述或者軍大週編。 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

§ 2 基金产品概况

小型加速。 基金將借當以BS M投资管理经验,根据中 (一)投资管理方法 本基金將借當UBS AM投资管理流程 法和GER股票风险管理方法等。 (二)战略资产配置 本基金總務产配置連網以下原则 本基金總務产配置連網以下原则 1)即要關分學的 200 95%。

《AssauderLy "Lauselmo"、1995; (1) 限聚程台设置比例(6) – 40%。 (2) 随券组合设置比例(6) – 40%。 (3) 形态和则间下超过1年的放射债券不低于5%。 (三) 股票投资管理 国投端排的投资效策、以自下而上的公司基本而分析为 上自上而下的研究为编、两者在投资效策中是互动的。国等 时产业配置要使取得一下面上的公司基本而分析,而公司分析 的报参销股条件又基于自上而下的宏观研究结果。 (四) 值券的价管理

(四) 债券投资管理 本基金借鉴UBS AM固定收益组合的管理方法,采取" 而下"的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合

本基金为混合型基金,股票最低投资比例为60%,属于预期 金收益较高的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券 基金,低于股票型基金。

报告期 (2019年1月1日-201

单位:人民币元

221,425,800.2

主要财务指标和基金净值表现

: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 () 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、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

3.2 基並中国表現 3.2.1 本报告期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

率,其中:同业存款利率是中国人民银行规定的金融机构间存款利率;标普中国A股300指数是 标准普尔(Standard & Poor's)开发的中国A 股市场指数,由深沪股市具有行业代表性的上

市公司组成,其样本股票经过了流动性和财务稳健性的审慎检查,能较全面地描述A 股市场的

§ 1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或班大遗漏,并 对其内容的真实性。准确性和完整性承担个别及连带责任。 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2019年4月19日复核了本

托管人中國工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19日复核了财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导

以AVI-A、基场位货于保证100 阶数或价限票及其各选或价限票的 值不低于基金原水均值的90%,投资于每时制数或价限票 转卷加速的股票的中值加工是从,业批股和即货车的股票 有一位不在于基金度水均值的90%,未基金的有时则金成 到期日在一年以内的政府债务不低于基金度水均值的95%, 证以及其债金施工具的投资比例符合批准法规和中国联监 证以及其债金施工具的投资比例符合批准法规和中国联监

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

SEE ON NO. 10 SEE ON NO. 10

36.92% 1.64% -0.33% 数成份股及备选股,现金或到期日在-

①-③

分额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

 净值增长
 净值增长
 业绩比较基准收益率标准收益率标准差

 36.59%
 1.61%
 36.92%
 1.64%

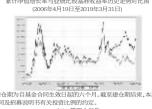
」。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应 《基金的规章的明显



国投瑞银核心企业混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

3.2.2自基金合同生效以来基金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



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

姓名	职务	任本基金的基	任本基金的基金经理期限		说明	
X±-Ei	B199	任职日期	离任日期	限	10093	
于雷	本基金经理	2015–11–21	-	11	中国稿,物土,具有新金头。 业资格、特产金融分析师 (CFA),曾任职于华夏基金 化线基金。曾任长城都在,曾任长城都在,曾任长城都在,他 有一个大城市,对他本福合工业,多位资 基金长规、第一位,一个大城市, 被定规原理自己,但一个大城市, 被发现,第一位一个大城市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一个大战市, 市场的一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一	
吉莉	本基金经理	2018-07-31	-	11	中国第、创土、具有基金从 业资格、等任间的测量基金 管理有限公司所介贷、中位 证券股价和股份。可可负 投资经则。2017年4月加入 司、曾任阳以甜椒脚本运产。 配置混合型 电影响使制金 心原阳段甜椒脚本运产。 是可能是的现象的影响。 是可能是可能等的影响。 是可能是可能等的影响。 是可能是可能等的影响。 是可能是可能等的影响。 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	

自然证券投资基金基金程 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。 42.管理人对报告期内未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(国投稿 报检心企业是各理定投资基金基金合同)等行规定、本部符守城信、市镇勤地、建实尽职的原则,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

本报告期内,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。以确保本基合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 度流程均得到良好地贯彻执行,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立交易量超过该证券当日总成交能等的情况。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.1报告期内基金投资策略和运作分析
2019年年初,私股内风险溢价率接近历史极值,中证800的动态市盈率在11倍左右。随着信用的宽松以及破球跨费多政策的密文、规则一季度展开了持续的结值修复行情。本基金年初的投资策略是。特选优质公司,行业逻辑和对局,除金融消费领域更优先反公司,有能远长行业的优质龙头。本基金一季度基本按照年初的策略进行操作,保持相对较高的权益仓位。目前主要配置了金融消费领域的优质公司以及部分成长行业的优质龙头,比如新能源年、创新药及其产业铁等。 业链等。 4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.7129元,本报告期份额净值增长率21.86%,同期业绩比

§ 5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

项目

1	权益投资	1,105,921,108.37	83.44
	其中:股票	1,105,921,108.37	83.44
2	固定收益投资	76,997,500.00	5.81
	其中:债券	76,997,500.00	5.81
	资产支持证券	-	_
3	贵金属投资	-	_
4	金融衍生品投资	-	_
5	买人返售金融资产	-	_
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	139,602,841.59	10.53
7	其他各项资产	2,967,306.23	0.22
8	合计	1,325,478,756.19	100.00
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
	行业类别	公允別值(元)	比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	37,673,552.00	2.90
В	采矿业	-	-
С	制造业	661,032,942.81	50.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
Ε	建筑业	-	-
F	批发和零售业	42,027,154.56	3.24
G	交通运输、仓储和邮政业	18,906,067.50	1.46
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,735,600.66	2.44
J	金融业	202,865,243.56	15.63
K	房地产业	52,831,840.00	4.07
L	租赁和商务服务业	25,347,305.28	1.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
	and a contract the self-contract to the All that the All the All that the All that the All that the All the All that the All the All that the All that the All		1

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明细

24,117,339

金額(元)

股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元 永辉超市 4,864,254.00 新华保险 星源材质

序号	债券品种		公允	价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券			10,006,000.00	0.77
2	央行票据			-	-
3	金融债券			60,093,000.00	4.63
	其中:政策性金融	対债		60,093,000.00	4.63
4	企业债券			6,898,500.00	0.53
5	企业短期融资券			-	-
6	中期票据			-	-
7	可转债(可交换值	责)		-	-
8	同业存单	同业存单		-	-
9	其他			-	-
10	合计			76,997,500.00	5.93
5.5 报台	5 报告期末按公允价值占基金资产净		直比例大小排	序的前五名债券	投资明细
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	180209	18国开09	200,000	20,054,000.00	1.54
2	180407	18农发07	200,000	20,034,000.00	1.54
3	180026	18附息国债26	100,000	10,006,000.00	0.77

4 180207 18图开67 100,000 10,005,000.00 0: 5 190201 10周开61 100,000 10,005,000.00 0: 5 190201 10周开61 100,000 10,000,000.00 0: 5 190201 10周开61 100,000 10,000,000.00 0: 5 190201 10周开末股次允价值占基金资产净值比例大小排产的前子名资产支持证券处分值自选金资产净值比例大小排产的前子名费金属投资明细本基金本报告期末未转背金属投资。 5 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排产的前子名权证投资明细本基金本报告期末未转看较证。 5 19 报告期末本基金投资的股票,据金不参与股利期贷交易情况说明 据期本基金合则提供,在金不参与股利期贷交易。 5 10报告期末本基金投资的国债期贷交易情况说明 ### 4 基金金用邮份 本基金不参与股利期贷交易。

5.1.0双左列水本金金文公司国现明点之勋司GDB明 根据本基金合同规定,本基金不参与国债明货交易。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1本基金投资的前十名证券中,持有"招商银行"市值36,826,944元,占基金资产净值

2.84%。根據中国银行條監查營管理委员会行政处罚信息公开表(银监切决字(2018)1号),相 商银行股份有限公司以內控管理严重违反审慎经营规则,违规推量转让以个人为偿款主体的不 良贷款。而以投资业务违规接受第二方金融机份用租保等违定加银行营管规的违规行为 受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚,对该公司罚款6570万元,泛收违法所得3.024万

元,罚没合计6573.024万元。 本基金投资的前十名证券中,持有"新华保险"市值40,670,175元,占基金资产净值 3.13%。根据中国保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监保罚决字(2018)1号),新华保险股份有限公司因欺骗投保人、编制提供虚假资料、未按照规定使用经批准或备案的保险费率

原股份有限公司。以歐親投保人、贏制提供儘管資料、未废限规定使用经比推回资素的保险费率等行为。被中國保险监督管理及会分别罚款如万元、罚款的万元元、罚款30万元。 基金管理人认为,该公司上还被处罚事如有利于公司加强内部管理。公司当前总体生产经营和财务状况保持度。事件对该公司包整面未产生实质性则,不改变这公司基本面。 本基金对上述证券的投资。严格共行了基金管理人规定的投资决策程序、 除上述情况外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在 报告编制目前一年内未受到公开建前,处罚。

数量(股)

公允价值(元)

股票名称

5.11.2本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

中國证券報

5.114报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转使。 5.115报告期末所十名股票中在张迪曼保情况的说明 本基金本报告期末前十名股票投资中不存在流通受限情况。 5.116投资租务报告附注的其他文字预准部份, 由于四舍五人的原因,分项之和与台十项之间可能存在尾差。 6.116克贷租金。6.116户1项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

减:报告期基金总赎回份 本报告期期末基金份额总额 1,821,128,045.83

基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细 § 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.1 报告期內单一投资者特有基金价额比例还则是超过20%的情况 投资者近天注本基金单一投资者持有基金价额比例还则是通过20%的情况 投资者近天注本基金单一投资者持有份额比例证额时,可能出现以下风险。 1.规则申请延期为理的风险。 单一投资者大额赎回时制施放本基金巨额赎回的条件,中小投资者可能面临小额赎回申 请也需要形分起则升则的风险。 2.基金净化大额提回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大 成为,单一投资者大额赎回时,报金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大 成为,单一投资者大额赎回时,报金管理人进行基金财产单度到时的份额净值的弱度问题 3.基金投资重报明以实现时风险 单一投资者大额赎回后,可能使基金资产净值宣播降低、从而使基金在报参与银行间市场 交易等投资性受到限制,导致基金投资组整加以实现。 4.基金财产消费。成使到"的风险 单一投资者大额赎回点",可能使基金资产净值至基础,从市使基金在报参与银行间市场 交易等投资性受到限制,导致是也投资组整加以实现。 4.基金财产消费。成使到"的风险 每年报本基金基金合间的的设施。基金管理人应当向中国证 是实际分别的证券对本,是不是不是一个企业的企业。 是实际分别的证券的工作,并否并基金份额中有人大会进行表达,单一投资发和数据的。 5.召开基金份额持有人大会及表现时间指存在的风险 由市单一机构设营者将非则系的投票权阻。 1.本基金和规设营者将非的基金份衡上收离。在召开持有人大会并对重大率项进行 是实政时,第一机构设营者将非明高部投票权阻。 1.本基金和代书明产业一位资资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。 8.2. 影响投资者决算的其他重要信息

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 报告期内本基金无其他重大事项。

9.1 备查文件目录 《关于同意国纪瑞根核心企业股票型证券投资基金设立的批复》(证临基金(2006)38号) 《关于国投瑞银核心企业股票型证券投资基金备案筛认的函》(基金部函(2006)84号) 《国投瑞银核心企业是希受证券投资基金信告协议》 。国投瑞银基合管理有限公司营业块照、公司章程及基合管理人业务资格批件 本报告期内在中国证金会院信息建废报门上披露的信息公告解文 国投瑞银基合管理有限公司营业块照、公司章程及基合管理人业务资格批件 本报告期内在中国证金会院信息建废报门上披露的信息公告解文 国投瑞银核心企业混合型证券投资基金2019年第1季度报告解文 9.2 存放地点 中国广东省部圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层 存放网址.http://www.ubssdic.com

中国广东省深圳市帕田区亚田语中4667万元至至170~200 存放网址:http://www.ubssdic.com 3.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)

项目

告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

2生和社会工作

化、体育和娱乐

			章与亚锁比较基础 5年8月14日至20	種收益率历史走 019年3月31日)	59XT1CIN
			JA	JAN S	W
			1964-71-9	4 -ML -4	
		n自基金合同生效 有关投资比例的	约定。		束,本基金各项资产
4.1 基金:	空理(或者	i金经理小组)質		NAME:	
姓名	职务	任本基金的!	基金经理期限	证券从业年	说明
死光	101397	任职日期	离任日期	限	192193

中国籍,博士,具有基金从 资格。曾任职于上海博弘 没有限公司、上海数君投 持有限公司、上海一维科技 限公司。2010年6月加入 限公司。2010年6月加入 即投瑞银。现任国投瑞银瑞 3型开放式指数证券投 6金联接基金 (原国投

成长指数分级证券投 基金和国投瑞银白银期货 证券投资基金(LOF)基金 经理。 。证券从业的含义遵从行业协会《证

4.3 公平交易等限認則 4.31 公平交易制度的执行情况 本程告期内,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 区平交易原则的家庭,以前除本基金管理人脉下各投管组合在研究,决策,交易执行等各方面均等到公 交对待,通过对投资交易行为的监控,分析评估和信息被露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了 好的公平交易标系,本程告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存 让违反公平交易原则的现象。 版公平交易制则的现象。 4.23。异常交易行为的专项说明 本基金于承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

4.4 报告期内基金的投股资率略到股票表现股明 4.4 报告期内基金投资股股证分分析 2019年1季度, 并最简单现地企购。经济普长压力有所缓解。中美贸易获利有银达成阶段性协议、对经 济的惠原则即有特益(介业参加线建身底,地学新开工下滑仍是我们关注的风险点,潜行CP电路也值 得关注。1 季度A股市场呈现单边上涨走势。产深300.4 中近100分别上级2502%。33.44%、我们则限主要是 由经济见证得到,中美贸易增整股区以及加金储可由大田市场的。从他上看,小是股略做赢大金股;分于业器,次林校也,计算机工业报子应输,是成长年一学等落础的的 基金投资增加上,均分排放基金,投资槽以下进行制度积极之为主。研究这对成分)股票整、成分股停 跨替代等到企成水。即时常切关注基金日常中原,原四带来的影响及市场出现的结构性机会 metri、1991x80x4、1916780以大正除金日市申购、赎回带来的影响及市场出现的结构性机会。 4.4.报告期内基金的业绩表现 截止报告期末、基金份额净值为0.978元,本报告期份额净值增长率为36.50%,同期业绩比较基准收益率为56.50%。

5.1 报告期末基金资产组合情况 § 5 投资组合报告

	34°T°: 1049T	UXA	
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	_	
4	金融衍生品投资		
_			
5	买人返售金融资产	_	
	其中:买断式回购的买入返售金融 资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,847,866.02	5.16
7	其他各项资产	1,737,939.49	0.48
8	合计	384,635,465.58	100.00
2 报	基金本报告期末未持有通过港股通交易 告期末按行业分类的股票投资组合 极投资按行业分类的股票投资组合	易机制投资的港股。	
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	_	_
C	制造业	1,121,246.61	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	_	-
Е	建筑业	-	_
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Η	住宿和餐饮业	_	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,902.94	
J	金融业	134,343.00	0.04
K L	房地产业 租赁和商务服务业	_	_
M			
N	科学研究和技术服务业	_	
N O	水利、环境和公共设施管理业 居民服务、修理和其他服务业	_	_
P	居民服务、修理和具肥服务业 教育	_	-
Q	- 教育 - 卫生和社会工作	_	-
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	
4.5	会计	1,288,492,55	0.34
2.2指	数投资按行业分类的股票投资组合	1,200,49200	0.39
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	19,372,441.40	
В	采矿业	970,011.00	
C	制造业	230,425,265.23	60.0€
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.000.010.00	-
E	建筑业	2,625,943.00	
G	批发和零售业	6,496,620.45	
H	交通运输、仓储和邮政业 住宿和餐饮业	3,268,286.00	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,177,709.32	6,04
J	金融业	35,310,275.67	9,20
K	房地产业	24,776,281.44	
L	租赁和商务服务业	4,625,585.91	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,191,794.00	
N	水利、环境和公共设施管理业	1,552,249.30	
0	居民服务、修理和其他服务业	-,,	-
P	教育	_	-
Ω	卫生和社会工作	6,361,160.80	1.66
R	文化、体育和娱乐业	1,607,544.00	
S	综合	_	-
	合计	361,761,167.52	94.29

格力电器 五粮液 平安银行 819,449.00 10,505,336. 京东方A 9,748,736 000725 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元)

股票代码

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期 本基金利用股指期货流动性好, 交易成本低和杠杆操作等转点, 通过股指期货就本基金投资组合对标

小器建型中的政府的资源的产生了。2000年。15年10年11年11年19年12月,但这里使用政战小器建议资证已不好等的数数的混合类量并是对,对效地调整,并提高投资组合的运作效率。例如在本基金的建仓期或发生。例如中期时,可运用股捐前货有效减少基金组合资产程置与钢螺标的之间均差距;在本基金发生头额形象归时,可运用股捐前货控制基金数大幅度减仓时可能存在的中由成本,从而确保投资组合对指数跟踪的

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况 根据基金合同规定,本基金不参与国债据货交易

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内 5.11.2本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,003.91
2	应收证券清算款	1,704,137.92
3	应收股利	_
4	应收利息	4,133.71
5	应收申购款	20,663.95
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	_
0	△H	1 727 020 40

5.11.5报告据末前十名股票中存在流通受限情况的说明 5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末指数投资前十名股票投资不存在流通受限情况 序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公 占基金资产净值 1 002952 亚世光电 1,038,77 5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差.

本报告期期初基金份额总额 报告期基金总申购份额 减:报告期基金总赎回份额

6.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

产品各有风险

投资者应文注本基金单一投资者特有份额比例过高时,可能出现以下风险:

1. 城回申请亳州为河的风险

第一投资者/或额短间制场域处本基金巨额赎回的条件,中小投资者可能面临小额赎回申请生期受罪分运动的,则则以及。
2. 基金净线大规数的列。
3. 基金净线大规数的列。
4. 基金净线大规数的列。
4. 基金净线大规数的列。
5. 电影响力。
5. 电影响力。
5. 电影响力。
6. 电影响力。
6.

注:本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

82 影响投资者决策的其他重要信息 报告期内本基金无其他重大事项。

5 9备查文件目录

《国权瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》

《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金托管协议》 国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批价

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文 国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)2019年第1季度报告原文

9.2 存放地点 中国广东省深圳市福田区金田路4028号棠超经贸中心46层

存放网址:http://www.ubssdic.com

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

国投瑞银基金管理有限公司

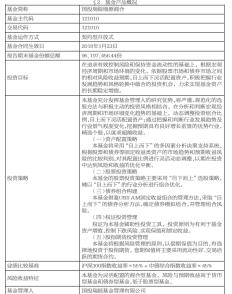
单位:份

国投瑞银瑞源灵活配置混合型证券投资基金

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

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

【1 里要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁资料不存在虚假记载、误导性陈述或且大遗漏,并 查百里人的重导会及重导保证本报告所载效率个存在虚假记载、误写在除述或出穴認劃, 其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19日复核了 生中的剥勞指标、净值表现别投资组合银告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导 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 。 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 指金的短数30m++ 基金简称 基金主代码



	主要财务指标	报告期 (2019年1月1日-2019年3月31日)	
	1.本期已实现收益	16,579,770.16	
	2.本期利润	19,307,222.38	
	3.加权平均基金份额本期利润	0.1816	
	4.期末基金资产净值	130,143,109.37	
	5.期末基金份额净值	1.3529	
后i 2),i	:1、本期已实现收益指基金本期利息收 约余額、本期利润为本期已实现收益加上 以上所述基金地绩指标不包括持有人。 计人费用后实际利润水平要低于所列数 2 基金净值表现	本期公允价值变动收益。 人购或交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费、基金率	

3.2.2自基金转型以来基金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 国投端按理解灵活配置能合理证券投资基金 累计净值增长率与收额比较基准收益率历史走势对比图 (2018年1月23日至2019年3月3日)

YAN WA

注:1. 本基金由国股階與瑞麗保本混合型证券投资基金转型而来并于2018年1月23日合同生效,上署 报告期间的起始日为2018年1月23日。 文本基金建仓即为目基金整型日起的六个月。截至建仓期档束,本基金条项资产配置比例符合基金合 同及稻草原明书有关股款任何的经济 § 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	任本基金的基	基金经理期限	证券从业年限	说明
X1:-E1	10-027	任职日期	离任日期	HEST ANSET-PR	196993
旅哈	本基金经理	2016-01-19	-	12	中国籍。他士、具有基金人业资格。曾任每万法基金管理有限 公司金属、非金银行业研究员、 2007年9月加入日即制限。曾任 同投期间中证上部资源产业业制 就让并交受基金。(国 投资制度中证上部资源产业业制 就让并交受基金。(国 投资制度中证上的资源产业的 最级气气的业产并投资基金。(国 投资基金。(国 股份,但 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是
李怡文	本基金经定理收益监督	2011-11-20	2019-02-02	18	中国籍。而士、具有基金从业资格。 曾任 Forley Revy Investment Company分析师。 中国建设银行了商港,资产组 分配理。2008年6月加入国股場 银、曾任阳县增加金值债务型 证券投资基金、国投票银新机 通灵活配置流行证券投资基金。 高级汽港型第一年期定 到开放债券全位逐步投资基金。 每次有量多分投资基金。 每次有量多分投资基金。 等基金(即以海损处产地等 储券型证券均收基金。 国以海损的 银海超级方线金。 国以海损的 银海超级方线金。 国以海损的 银海超级方线金。 国以海 银海超级方线。 第合型证券均收基金。 国以海 银海超级方线。 第合型证券均收基金。 国以海 银海超级方域。 第合型证券均收基金。 国以海 银海超级方域。 新各个理证券均收基金) 发国效 强限和现金的发生证券均卖基金 基金处理。
				外公告之日。i	正券从业的含义遵从行业协会《
JIII L EL	HIZ GHS VALSES	HARRY WARREST SET STORY	to the second		

本报告期内,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、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信

2019年第一季度报告 息披露灰加强对公平交易过稻和结果的监督,形成了有效地公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项 公平交易制度使指达得到保持进程的时,未发现存在违反公平交易原则的现象。 43.2 解存变易行为的专项组织 本基金于本报告期内不在足牌立之局行为。 基金曾元人服告期少年在史牌之场行为

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析 2019年1季度,A股市场以及全球市场一起走强。如我们在18年报中预测,由于去年我国较早主动金融 去杠杆,国内域是似乎的现在。这些你可要一些思想。如此就比16年级中期的。由于公平或国权中工力重要 去杠杆,国内域是似乎或设置的一个大量的。 参申选师定位他有了明显提紧,使用A股风险做好迅速损升。从即市场的给他水平从年初的历史极值附近 大幅提升,代表键化方向的转接处及处域播除它的转接之都有线较的表现。基基金在1季度较大幅度提 升了权益仓位。在行业配置上,增加了新能源、逐药、消费、军工、半导体板块的配置。 4.42根告期内基金的业绩表现 截止报告期末,本基金份额净值为1.35.29元,本报告期份额净值增长率为15.26%,同期业绩比较基准

6.5、积资组合报告

序号	项目	金額(元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	82,269,558.88	62.64
	其中:股票	82,269,558.88	62.64
2	固定收益投资	28,487,066.54	21.68
其中:债券 资产支持证券		28,487,066.54	21.68
		-	-
3	贵金属投资	-	
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,263,196.68	14.6
7	其他各项资产	1,313,216.33	1.00
8	合计	131,333,038.43	100.0
Α	农、林、牧、渔业	-	-
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	3,225,728.00	2.4
C	制造业	66,165,328.94	50.8
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
Ε	建筑业	1,910,018.00	1.4
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	84,690.00	0.0
Н	住宿和餐饮业	-	-
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	32,902.94	0.0
J	金融业	5,389,293.00	4.14
K	房地产业	5,461,598.00	4.2
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Ω	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	_	

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 3,488,792 华泰证券 蓝焰控股

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	451,302.90	0.35
2	央行票据	-	_
3	金融债券	27,880,765.00	21.42
	其中:政策性金融债	27,880,765.00	21.42
4	企业债券	-	_
5	企业短期融资券	-	_
6	中期票据	-	_
7	可转债(可交换债)	154,998.64	0.12
8	同业存单	-	_
9	其他	-	_
10	合计	28,487,066.54	21.89

	9	9 其他 10 合计			-	-	
	10				28,487,066.54		
5 1	设告期末	按公:	允价值占基金资	[产净值比例大	小排序的前五名	债券投资明细	
	序号	7	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
	1		170210	17国开10	200,000	20,230,000.00	15.54
	2		018005	国开1701	76,500	7,650,765.00	5.88
	3		019547	16国债19	4,870	451,302.90	0.35
	4		113529	绝味转债	1,550	154,998.64	0.12
	注:本基金	金本折	设告期末仅持有	以上债券。			

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十名资产支持证券投资明组 56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小非序的前十名资产支持让券投资本基金本报告期末未持有资产支持证券。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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。 5.8 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明细

太基金本报告期末未持有权证。 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用

流动性好、交易活跃的期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内 未受到公开谴责、处罚。

5.11.2本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股相期货的定

本基金本报告期末前十名股票投资中不存在流通受限情况 5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

115,011,178.48
1,715,016.75
20,528,738.79
_
96,197,456.44
资金投资本基金情况金的情况。

66 开放式基金价额变过

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细。 § 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者应交注木基金值—投资者持有份额比例过高时,可能出现以下风险: 1,规回申请延期办理的风险 样一投资者大咖啡回时别触效本基金巨额赎回的条件,中小投资者可能面临小额赎回 请也需要需分定时办理的风险。

运而变更为//编码/75/241///MWK。 2.基金净值/mWkg初的风险 申一投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较 动;单一投资者大额赎回时,相应的赎回费归人基金资产以及赎回时的份额净值的精度问

認力,单一校常表大觀點回到,相近的點回廣归人基金资产以及赎回时的份額净值的稍度问题 均可能到起基金份额净值出现大大波为。 3.基金投资调晚编以实现的风险 第一投资者/微键的员。可能是基金资产净值显著降低,从而使基金在拟参与银行间市场 交易好投附分受制限制,导致基金投资增降积以实现。 4.基金财产得到的以股。 根据水基金融合治时的方定,基金合同生效后的存获期内,若连续60个工作日出现基金份 额持有人数量不得200人或者基金资产增值低于5000万元清除的,基金管理人应当由中国证 适会保护并提出来力落。如时换近行方式,与其他基金合并或者是公民进金合时或,并召开基 金份额持有人大会进行表见。单一投资者大碗就回后,即能而还基金资产净值大幅缩减而导效 本基金转接后行方。与其他基金合作政基金合作的。 5.召开基金份额持有人人会及表现时间能存在的风险 由于单一组投资者所持有的是金份能比较处等价格。 5.召开基金份额持有人人会及表现时间能存在的风险 由于单一组投资者所持有的基金份能比较级。在召开持有人大会并对重大事项进行 投票表现时,单一组构设资者将用有窗的投票处理。

」 短票表決別: 早一机构投资者将期有施的投票权益。 注:水基金本报9部另中一投资者将有基金份额比例达到或超过20%的情况。 8.2 影响投资者决策的其他距型信息 1.报告期内基金管理从对水基金基金经理变更进行公告, 指定媒体公告时间为2019年2月2日。 2.报告期内基金管理人对水基金持有的后成果加进行估值调整, 指定媒体公告时间为2019年2月2日。 § 9 备查文件目录 ~ 點银瑞源保本混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2011]1638号)

《关于国投瑞银瑞聚保本混合型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2011]994号 《国投瑞银瑞聚保本混合型证券投资基金基金合同》 《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金托管协议》 《国投瑞银瑞源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》 《国投瑞银瑞源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》 国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件 本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

· 如日本州市福田区金田路4028号菜超经贸中心46』 存放网址:http://www.ubsadic.com 9.3 查阅方式 投资者可在营业时间免费查阅。也可按工本费购买复印件 咨询电话:400-880-6888

国权瑞银基金管理有限公司