

国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

市场,不同发行主体期限,能够较好地反映中债债券市场总体价格水平变动趋势,综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金选用沪深300指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。

2.本基金业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2日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变动比较

国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金历史走势图
(2016年12月20日至2019年6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。

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
李博	本基金基金经理	2016-12-02	-	14

注:任职日期和离任日期均指公司公告任命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。

4.2 管理人对于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(《国投瑞银国家安全灵活配置混合型证券投资基金合同》)等有关规定,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。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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。本报告期内,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情况。

4.2.2 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多的且交易金额超过证券当日总成交量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报告期内本基金投资策略和运作分析

2019年2季度,根据一季报和二季报的预告对组合做了调整。在产业层面,

国防工业核心军工公司表现良好,反映了重要军品的交付计划如期执行。

2019年是“十三五”军事装备建设的第四年,军改后机关与军工集团磨合逐步走向成熟,部分民参军企业业绩出现大幅下滑,基本面恶化,无论股东背景深厚与否,没有技术含量和良好公司治理的公司难以获得持续竞争优势。组合调整的目的是纳入基本面向上并且管理优良的公司,规避基本面不及预期和竞争优势衰

落的公司。

截至报告期末,基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.673元,本报告期份额净值增长率为-3.11%,同期业绩比较基准收益率为-0.65%。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,136,136,409.88	93.81
2	固定收益投资	1,136,136,409.88	93.81
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产投资	-	-
9	其中:买入返售的买入金融资产投资	-	-
10	合计	1,136,136,409.88	93.81

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	363,421.26	0.03
B	医药、生物	1,036,276,009.88	87.94
D	电力、热力、燃气及水生产供应	232,007.00	0.02
E	建筑业	72,662.34	0.01
F	采矿业	17,270.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	33,890.00	0.00
L	制造业	10,069.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,619.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	房地产业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	30,669.00	0.00
S	综合	-	-
合计		1,136,136,409.88	94.87

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

6 投资组合报告

6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000700	中航电子	3,598,979.00	114,341,260.37	9.77
2	600308	中航光电	2,766,252.00	113,473,299.37	9.77
3	600897	一拖股份	10,000,000.00	113,461,429.00	9.66
4	000708	中航重机	7,720,350.00	112,121,682.76	9.62
5	002013	中航机电	36,209,444.00	112,040,072.00	9.62
6	600372	中航电子	7,362,796.00	100,709,056.14	9.31
7	600890	一汽轿车	2,343,000.00	109,033,052.82	9.27
8	600662	国投科技	4,963,677.00	76,261,159.72	6.61
9	600544	鲁商置业	4,420,776.00	70,569,809.68	6.05
10	002214	大众交通	4,375,000.00	41,820,900.00	3.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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五名债券投资

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

本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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资策略

为了更好地实现投资目标,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆率高等特点,通过股指期货做本基金投资组合进行及行,有效地调整,并提高投资组合的运作效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	589,408.08
2	应收证券清算款	6,761,016.00
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	40,336.04
6	其他应收款	815,332.96
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,116,175.08

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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.7 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.8 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。

5.11.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.11 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.12 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。

5.11.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.15 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.16 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。

5.11.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.18 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.19 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.20 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。

5.11.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.23 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.24 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。

5.11.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.26 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.27 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.28 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。

5.11.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.30 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.31 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.32 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。

5.11.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.35 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.36 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。

5.11.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.38 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.39 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,226.03

5.11.40 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。

5.11.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.42 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.43 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,498.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	100,727.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20