

国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金

2015年6月30日

2015】第二季度报告

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
报告书日期:2015年7月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。
基金托管人对本报告复核无误。
基金管理人和基金托管人保证本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等数据真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金合同当事人承诺在本报告中不提供虚假信息，投资者应及时关注基金的定期报告，以获取基金的最新情况。
本报告中财务数据未经审计。
本基金合同生效日:2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金概况

基金简称 国投瑞银瑞利混合

基金主代码 161223

基金运作方式 灵活配置混合型基金,本基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务,期间投资人可向本公司申请开放式通过场外直销系统转为基金份额,封闭期结束后,投资人可在场内申购、赎回本基金。

基金合同生效日 2015年2月5日

基金期末基金份额总额 1,032,419,055份

投资目标 在有效控制风险的前提下,通过对股票与债券等资产的合理配置,力争基金经理的资产增值。

投资策略 本基金的投资策略包括但不限于资产配置策略、股票投资策略、折价与溢价策略、(一)资产配置策略:本基金将根据宏观经济形势以及市场环境的变化适时调整资产配置比例,以期在投资中达到风险收益的平衡。
(二)股票投资策略:
1. 在进行股票投资时,将主要采用自下而上相结合的方式确定行业配置。在综合运用基本面分析、技术分析、估值分析等多种方法的基础上,结合对宏观经济形势以及市场环境的判断,选择具有较好投资价值的行业,并在此基础上进行行业配置。
2. 在进行股票投资时,将主要从以下两个方面进行股票筛选:(1)行业选择:本基金在注重风险管理的前提下,以长期保值为目的,适度运用股票投资策略。
(3)行业选择策略主要包括可转债投资策略,定向增发策略,大宗交易策略等。
(4)债券投资策略:
1) 山证债基定期投资策略:本基金在注重风险管理的前提下以长期保值为目的,定期投资于国债、企业债、公司债、金融债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可分离债、央行票据、资产支持证券等。
2) 其他更积极投资策略:本基金在注重风险管理的前提下以长期保值为目的,定期投资于国债、企业债、公司债、金融债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可分离债、央行票据、资产支持证券等。
3) 业绩比较基准:本基金在注重风险管理的前提下以长期保值为目的,定期投资于国债、企业债、公司债、金融债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可分离债、央行票据、资产支持证券等。
4) 风险收益特征:本基金为高风险、高收益的基金品种,其长期风险和预期收益高于货币基金、短债基金。

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

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 120,656,772.83

2.本期利润 82,106,975.21

3.加权平均基金份额本期利润 0.0425

4.期末基金资产净值 2,095,217,785.70

5.期末基金份额净值 1.084

注1.本基金已实现收益指收入总额减去必要的费用后的余额,其中包含利息收入、手续费收入、公允价值变动收益、赎回费、基金转换费等,计入费用后实际利润水平。

注2.本期利润指基金利润总额减去必要的费用后的余额,其中包含利息收入、手续费收入、公允价值变动收益、赎回费、基金转换费等,计入费用后实际利润水平。

注3.基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

注4.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

注5.基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

注6.本期已实现收益、本期利润、加权平均基金份额本期利润、期末基金资产净值和期末基金份额净值均经审计。

注7.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注8.管理人报告

注9.本基金合同生效日为2015年4月1日起至6月30日止。

注10.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注11.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注12.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注13.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注14.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注15.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注16.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注17.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注18.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注19.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注20.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注21.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注22.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注23.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注24.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注25.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注26.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注27.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注28.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注29.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注30.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注31.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注32.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注33.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注34.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注35.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注36.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注37.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注38.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注39.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注40.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注41.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注42.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注43.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注44.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注45.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注46.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注47.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注48.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注49.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注50.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注51.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注52.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注53.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注54.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注55.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注56.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注57.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注58.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注59.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注60.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注61.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注62.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注63.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注64.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注65.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注66.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注67.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注68.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注69.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注70.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注71.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注72.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注73.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注74.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注75.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注76.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注77.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注78.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注79.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注80.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注81.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注82.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注83.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注84.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注85.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注86.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注87.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注88.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注89.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注90.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注91.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注92.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注93.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注94.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注95.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注96.本基金合同生效日为2015年2月5日,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

注97.本基金合同生效日为2015年2月5