

国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金

2017年度报告摘要

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
报告送出日期：二〇一八年三月二十七日
§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员在履行职责时，因违反法律、行政法规、规章、自律规则，被中国证监会及其派出机构采取了行政监管措施，或涉嫌违法违纪，被司法机关、监察机关立案侦查，该基金管理人应当及时向中国证监会及其派出机构报告，并依法履行信息披露义务。
基金合同中约定的基金管理人有损害基金份额持有人利益行为时，在2018年3月27日《基金合同》生效后的财务状况、净值表现、利润分配、费用计提、报告书等内容内，保留基金管理人因该等情形而被处罚的信息，但不得损害基金份额持有人的利益。

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，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资者投资本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件，了解基金的具体情况。

本公告仅为2017年1月1日至2017年12月31日的定期报告。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 国投瑞银优选收益混合基金
基金代码 001098
交易代码 001098
基金运作方式 灵活配置型基金
基金合同生效日 2016年4月16日
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
基金合同生效日 60,561,072,019
基金类型 混合型基金

基金产品说明 在严格控制风险的基础上，通过不同资产类别的优化配置及精选策略，力求实现基金资产的长期稳健增值。

投资目标 本基金的投资策略是通过不同资产类别的优化配置，把握投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

基金资产配置比例 本基金投资于股票类资产的比例为0%至50%，其中投资于港股通股票的比例不超过股票类资产的80%；投资于债券类资产的比例为0%至50%；投资于货币市场工具的比例为0%至100%；投资于权证、资产支持证券、国债期货、股票期权等金融衍生品的比例合计不超过基金资产净值的10%；投资于现金类资产的比例不低于基金资产净值的5%。

投资策略 本基金将根据宏观经济指标的变化和对市场的判断，进行行业配置，把握投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

投资范围 本基金主要投资于国内依法设立的证券交易所上市的股票（包括A股、B股、存托凭证）、港股通股票、债券（包括国债、地方政府债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、国债期货、股票期权等）、权证、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货、股票期权等金融衍生品、现金类资产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。

投资限制 本基金不得投资于法律法规禁止投资的领域，也不得投资于剩余期限超过397天的债券品种。

投资比例 本基金投资于港股通股票的比例不超过股票类资产的80%。

风险收益特征 本基金为混合型基金，属中高风险、中高收益品种，预期风险和预期收益率高于股票基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险的基础上，通过不同资产类别的优化配置及精选策略，力求实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金将根据宏观经济指标的变化和对市场的判断，进行行业配置，把握投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

投资范围 本基金主要投资于国内依法设立的证券交易所上市的股票（包括A股、B股、存托凭证）、港股通股票、债券（包括国债、地方政府债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、国债期货、股票期权等）、权证、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货、股票期权等金融衍生品、现金类资产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。

投资限制 本基金不得投资于法律法规禁止投资的领域，也不得投资于剩余期限超过397天的债券品种。

投资比例 本基金投资于港股通股票的比例不超过股票类资产的80%。

风险收益特征 本基金为混合型基金，属中高风险、中高收益品种，预期风险和预期收益率高于股票基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 国投瑞银基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

信息披露义务人 刘枫 龚晓

联系电话 400-880-6998 010-63674679

电子邮箱 service@ubtfund.com yhzq_kygs@chinatecbank.com

客户服务电话 400-880-6998 95561-400-8888-6998

传真 0755-29040948 010-63669362

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 http://www.ubtfund.com

基金年度报告备置地点 深圳市福田区金田路4020号华强君域中心40层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

基金单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2017年 2016年

本期已实现收益 4,063,162.72 72,536,161.92

本期利润 5,059,640.97 36,244,146.00

加权平均基金份额本期利润 0.00363 0.0197

本期基金份额变动 0.74% -0.42%

3.1.2 期末基金余额数据 2017年末 2016年末

本期份额 64,076,406.00 61,000,260,000

本报告期份额变动 1,000 1,000

3.1.3 本期份额和本期份额变动比例 50% ±0.00%

3.2 风险收益特征

本基金的份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2015年4月16日至2017年12月31日)

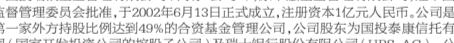


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的1个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及相关法律法规的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

3.3.1 年度 2017年 2016年

每10份基金份额 分红金额(元) 0.000 4,313.634

现金分红总额(元) 0.000 4,300,007.00

年度 2016年 2015年

每10份基金份额 分红金额(元) 0.000 3,851,926.00

现金分红总额(元) 0.000 3,849,030.00

3.3.2 年度 2017年 2016年

每10份基金份额 分红金额(元) 0.000 3,435,072.00

现金分红总额(元) 0.000 3,435,072.00

3.3.3 年度 2016年 2015年

每10份基金份额 分红金额(元) 0.000 3,431.634

现金分红总额(元) 0.000 3,431.634

3.4 基金管理人、基金经理

及基金经理的简介

4.1 基金管理人、基金经理的简介

4.1.1 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.1.2 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.2 基金管理人、基金经理的简介

4.2.1 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.2.2 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3 基金管理人、基金经理的简介

4.3.1 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.2 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.3 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.4 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.5 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.6 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.7 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.8 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.9 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.10 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。

4.3.11 基金管理人、基金经理的简介

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），即中融基金管理有限公司，经中国证监会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本人民币1亿元。公司是中国第一家中外合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银信托有限责任公司（国家开发投资公司的子公司）及瑞士银行有限公司（UBS AG），公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制机制，以“诚信、创新、包容、专业”的企业文化，截至2017年底，公司管理资产规模达490亿元。</p