国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、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、误导性陈述或者重大遗漏。
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利。
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读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银稳健增长混合
基金主代码	121006
交易代码	121006(前端) 128006(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月11日
报告期末基金份额总额	325,390,782.11份
投资目标	通过股票与债券等资产的合理配置,追求收益与风险的平衡,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略,注重风险与收益的平衡,本基金借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验,精选具有资源优势的优质上市公司股票和较高投资价值的债券,力求实现基金资产的长期稳定增长。 1、类别资产配置 本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别,对股票、债券和货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。 本基金股票投资占基金资产的比例为40%-80%,债券投资占基金资产的比例为0-60%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 2、股票投资管理 本基金的股票投资决策是:以自下而上的公司基本面全面分析为主,挖掘具有资源优势的优质上市公司股票,并使用GEVS模型等方法评估股票的内在价值。 3、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"自上而下"的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。 4、权证投资策略 考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即"估值差价(Value Price)"以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-21,965,412.44
2.本期利润	-16,277,557.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0504
4.期末基金资产净值	410,964,262.24
5.期末基金份额净值	1.263

注: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益)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(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

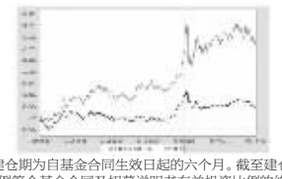
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.88%	0.95%	-0.87%	0.81%	-3.01%	0.14%

注:1、本基金属于混合型基金,一般情况下,本基金股票投资占基金资产的比例为40%-80%,债券投资占基金资产的比例为0-60%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。为此,综合基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金选用市场代表性较好的沪深300指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体业绩比较基准为"沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%"。
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。
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的比较

国投瑞银稳健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
(2008年6月11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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙文龙	本基金基金经理,基金投资部副总监	2015-05-09	-	8	中国籍,硕士,具有基金从业资格,2010年7月加入国投瑞银研究部。曾任国投瑞银景气行业证券投资基金基金经理。现任国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)、国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银创新动力混合型证券投资基金基金经理。

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。

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《国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,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和运作分析

2018年3季度,社融增速逐步下行,基建和房地产投资边际走弱,但经济韧性较强,企业盈利维持高位。中美贸易摩擦升级,未来经济增长的不确定性增加。展望四季度,宽货币紧信用的格局有望延续,房地产销售进一步回落,贸易摩擦对国内经济的影响也会逐步显现。

3季度A股市场震荡下行,沪深300、中证1000跌幅分别为2.05%、11.08%;风格上看,大盘股依然获得一定的相对收益;分行业看,仅银行、石油石化、非银、钢铁、国防军工取得正收益,其他行业基本都是下跌的。

本基金3季度维持中性仓位,超配了医药、电子、保险、军工、食品饮料等行业,其中保险、军工对净值是正贡献、医药、电子都是负贡献,整体未能获取超额收益。

本基金将沿着产业变迁和行业景气变化的思路,持有具备长期竞争优势的细分行业龙头,分享公司业绩成长,力争获取绝对收益和相对收益。

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1.263元,本报告期基金份额净值增长率-3.88%,同期业绩比较基准收益率为-0.87%。

§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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	271,476,440.13	65.66
	其中:股票	271,476,440.13	65.66
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	50,000,195.00	12.09
	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	91,466,875.03	22.12
7	其他各项资产	492,979.19	0.12
8	合计	413,436,489.35	100.00

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、渔业	13,107,690.00	3.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	194,832,192.96	47.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,734,519.00	0.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,382,378.31	6.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	26,348,161.96	6.41
K	房地产业	242,317.70	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,829,180.20	2.39
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	271,476,440.13	66.06

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明细

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	603368	柳药股份	655,939.00	19,212,453.31	4.67
2	601336	新华保险	333,077.00	16,813,726.96	4.09
3	002737	葵花药业	877,400.00	15,582,624.00	3.79
4	603228	景旺电子	246,219.00	13,389,389.22	3.26
5	300498	温氏股份	564,500.00	13,107,690.00	3.19
6	300037	新宙邦	507,600.00	11,994,588.00	2.92
7	603517	绝味食品	256,894.00	10,763,858.60	2.62
8	600038	中直股份	268,300.00	10,694,438.00	2.60
9	300232	洲明科技	1,076,665.00	10,497,483.75	2.55
10	600563	法拉电子	233,000.00	10,319,570.00	2.51

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明细
本基金本报告期末仅持有以上债券投资。
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细
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序的前五名权证投资明细
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
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。
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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	245,103.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,829.18
5	应收申购款	208,046.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	492,979.19

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
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	319,079,290.66
报告期基金总申购份额	15,473,794.83
减:报告期基金总赎回份额	9,162,303.38
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	325,390,782.11

§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

产品特有风险
投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时,可能出现以下风险: 1、赎回申请延期办理的风险 单一投资者大额赎回时易触发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部分延期办理的风险。 2、基金净值大幅波动的风险 单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大波动;单一投资者大额赎回时,相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。 3、基金投资策略难以实现的风险 单一投资者大额赎回后,可能使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等投资时受到限制,导致基金投资策略难以实现。 4、基金财产清算(或转型)的风险 根据本基金基金合同的约定,基金合同生效后的存续期内,若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。单一投资者大额赎回后,可能造成基金资产净值大幅缩减而导致本基金转换运作方式、与其他基金合并或基金合同终止等情形。 5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险 由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高,在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时,单一机构投资者将拥有高的投票权重。

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。

8.2 影响投资决策的其他重要信息

1、报告期内基金管理人对本基金在中金公司开通定投业务进行公告,指定媒体公告时间为2018年8月28日。
2、报告期内基金管理人对本基金在东海证券开通定投业务进行公告,指定媒体公告时间为2018年9月6日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
《关于核准国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]449号)
《关于核准国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金备案的确认函》(基金部函[2008]247号)
《国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
《国投瑞银稳健增长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
国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金2018年第3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号荣超经贸中心46层
存放网址:http://www.ubssdic.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:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、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、误导性陈述或者重大遗漏。
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利。
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读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银沪深300指数分级
基金主代码	161207
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月14日
报告期末基金份额总额	225,750,412.90份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深300指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪基准指数。 当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如流动性不足等)导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞和小康沪深300指数 / 国投瑞银瑞和远见沪深300指数
下属分级基金的场内简称	瑞和300 / 瑞和小康 / 瑞和远见
下属分级基金的交易代码	161207 / 150008 / 150009
报告期末下属分级基金的份额总额	177,570,262.90份 / 24,090,075.00份 / 24,090,075.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	1,983,129.40
2.本期利润	-1,423,854.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0062
4.期末基金资产净值	207,565,543.53
5.期末基金份额净值	0.919

注: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益)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(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

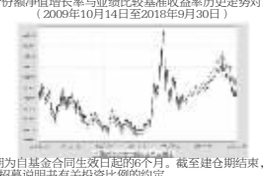
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.65%	1.24%	-1.92%	1.29%	1.27%	-0.05%

注:1、本基金是以沪深300指数为标的指数的被动式指数型基金,对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不低于80%,故以95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率作为本基金业绩比较基准。
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。
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的比较

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年10月14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6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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷瑞飞	本基金基金经理,量化投资部副总经理	2013-09-26	-	11	中国籍,博士,具有基金从业资格。曾任职于汇添富基金管理公司,2011年6月加入国投瑞银。曾任国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金、国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金、国投瑞银中证上证资源产业指数证券投资基金(LOF)、国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银中证500指数量化增强型证券投资基金基金经理。

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。

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《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,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和运作分析

2018年3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。过去几年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,股市持续震荡走弱。

基金投资操作上,作为指数基金,投资操作以严格控制跟踪误差为主,研究应对成分股调整、成分股停牌替代等机会成本、同时密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及市场出现的结构性机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.919元,本报告期份额净值增长率为-0.65%,同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

§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	190,885,977.34	91.18
	其中:股票	190,885,977.34	91.18
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	18,412,566.21	8.80
7	其他各项资产	43,937.91	0.02
8	合计	209,342,481.46	100.00

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积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	169,703.70	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	278,193.81	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	108,232.20	0.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	196,510.86	0.09
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	752,640.57	0.36

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	258,462.00	0.12
B	采矿业	6,814,198.03	3.28
C	制造业	74,816,045.17	36.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,227,532.37	2.52
E	建筑业	6,849,985.35	3.30
F	批发和零售业	3,454,707.52	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	5,783,628.43	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,795,403.74	3.27
J	金融业	65,451,384.12	31.53
K	房地产业	8,988,345.50	4.33
L	租赁和商务服务业	2,918,385.61	1.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	467,473.50	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	842,849.40	0.41
R	文化、体育和娱乐业	1,464,936.03	0.71
S	综合	-	-
	合计	190,133,336.77	91.61

5.2.3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期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
5.3.1期末指数投资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

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	601318	中国平安	183,086.00	12,541,391.00	6.04
2	600519	贵州茅台	8,781.00	6,410,130.00	3.09
3	600036	招商银行	203,986.00	6,260,330.34	3.02
4	601166	兴业银行	255,417.00	4,073,901.15	1.96
5	600016	民生银行	591,680.00	3,751,251.20	1.81
6	000651	格力电器	87,116.00	3,502,063.20	1.69
7	000333	美的集团	80,890.00	3,403,042.30	1.64
8	601288	农业银行	732,219.00	2,848,331.91	1.37
9	601328	交通银行	447,926.00	2,615,887.84	1.26
10	600887	伊利股份	101,190.00	2,598,559.20	1.25

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600485	信威集团	18,067.00	208,854.52	0.10
2	601577	长沙银行	17,329.00	196,510.86	0.09
3	601118	海南橡胶	25,635.00	169,703.70	0.08
4	601068	中铝国际	13,770.00	108,232.20	0.05
5	603583	捷昌驱动	1,321.00	69,339.29	0.03

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明细
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明细
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
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政策
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。
5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
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"兴业银行"市值4,073,901.15元,占基金资产净值1.96%。根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2018)1号),兴业银行股份有限公司因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告,非真实转让信贷资产,无授信额度或超授信额度办理同业业务等违反商业银行监管规定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587.0万元。
基金管理人认为,该公司上述被处罚事项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稳定,事件对该公司经营活动未产生实质性影响,不改变该公司基本面。
本基金投资的前十名证券中,持有"招商银行"市值6,260,330.34元,占基金资产净值3.02%。根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1号),招商银行股份有限公司因内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款,同业投资业务违规授受第三方金融机构信用担保等违反商业银行监管法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,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。
基金管理人认为,该公司上述被处罚事项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稳定,事件对该公司经营活动未产生实质性影响,不改变该公司基本面。
本基金对上述证券的投资严格执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	4,640.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,357.41
5	应收申购款	35,939.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,937.91

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期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1期末股票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细

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	3,403,042.30	1.64	重大事项停牌

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
2	600485	信威集团	208,854.52	0.10	重大事项停牌
3	601118	海南橡胶	169,703.70	0.08	重大事项停牌

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国投瑞银瑞和沪深300指数	国投瑞银瑞和小康沪深300指数	国投瑞银瑞和远见沪深300指数
基金合同生效日的基金份额总额	257,188,522.99	1,479,367,342.00	1,479,367,342.00
本报告期期初基金份额总额	175,099,877.83	26,329,091.00	26,329,091.00
报告期基金总申购份额	8,695,575.85	31,036.00	31,036.00
减:报告期基金总赎回份额	6,225,190.78	2,270,052.00	2,270,052.00
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	177,570,262.90	24,090,075.00	24,090,075.00

注:总申购份额含配对转换转入份额,总赎回份额含配对转换转出份额。

§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