



Disclosure 信息披露

2016年7月20日 星期三
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B48

国投瑞银优选收益灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30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
报告送出日期：二〇一六年七月二十日

§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。

基金管理人中国银行股份有限公司股份有限公司根据本基金合同约定，于2016年7月13日编制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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的风险揭示书。

本报告所载数据截至2016年6月30日止。

基金简称	国投瑞银优选收益混合基金
基金代码	001168
交易代码	001168
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月16日
报告期末基金份额总额	1,530,424,813.230
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过对不同资产类别的灵活配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中国综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，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	中国银行股份有限公司

§1 主要财务指标	§2 基金资产净值
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期末
1.本期利润总额	24,351,325.69
2.本期净利润	20,121,428.68
3.本期可供基金份额持有人分配的利润	0.0075
4.期末基金资产净值	1,607,735,409.68
5.期末基金份额净值	1.051

注：1.本期利润总额包括基本本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的金额，本期利润为本基金本期利润总额加上本期公允价值变动收益。

2.本期净利润是指扣除所得税费用后的本期利润。

3.本期可供基金份额持有人分配的利润是指本期利润扣除所得税费用后的本期利润。

4.期末基金资产净值是指期末基金资产净值减去本期基金资产净值变动额。

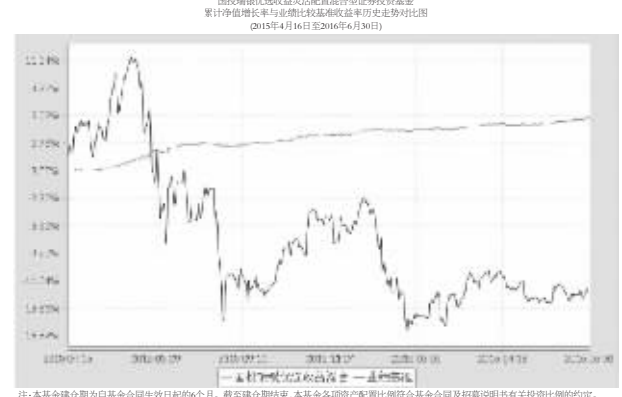
5.期末基金份额净值是指期末基金资产净值除以期末基金份额总额。

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.07%	-1.19%	0.51%	2.00%	-0.44%

注：1.本基金净值增长率是指基金净值增长率，业绩比较基准收益率是指业绩比较基准收益率。

2.本基金净值增长率是指基金净值增长率，业绩比较基准收益率是指业绩比较基准收益率。

3.本基金净值增长率是指基金净值增长率，业绩比较基准收益率是指业绩比较基准收益率。



姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
刘欣	本基金基金经理	2015-04-16	-	12
高虎	本基金基金经理	2016-06-02	-	8

注：任基金经理满任职期限的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

2.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

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：二〇一六年七月二十日

§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。

基金管理人中国银行股份有限公司股份有限公司根据本基金合同约定，于2016年7月13日编制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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的风险揭示书。

本报告所载数据截至2016年6月30日止。

基金简称	国投瑞银医疗保健混合基金
基金代码	000523
交易代码	000523
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月25日
报告期末基金份额总额	246,362,646.290
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过投资于具有良好发展前景的个股、行业及海外市场，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中国综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，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	中国银行股份有限公司

§1 主要财务指标	§2 基金资产净值
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期末
1.本期利润总额	7,705,026.71
2.本期净利润	22,640,704.46
3.本期可供基金份额持有人分配的利润	0.1224
4.期末基金资产净值	373,155,442.36
5.期末基金份额净值	1.511

注：1.本期利润总额包括基本本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的金额，本期利润为本基金本期利润总额加上本期公允价值变动收益。

2.本期净利润是指扣除所得税费用后的本期利润。

3.本期可供基金份额持有人分配的利润是指本期利润扣除所得税费用后的本期利润。

4.期末基金资产净值是指期末基金资产净值减去本期基金资产净值变动额。

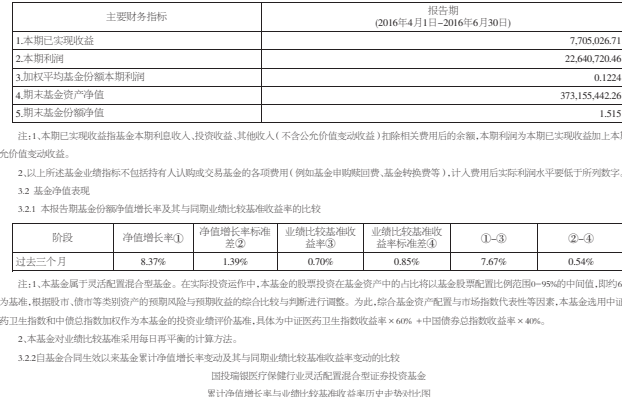
5.期末基金份额净值是指期末基金资产净值除以期末基金份额总额。

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	8.73%	1.29%	0.76%	0.85%	7.67%	0.54%

注：1.本基金净值增长率是指基金净值增长率，业绩比较基准收益率是指业绩比较基准收益率。

2.本基金净值增长率是指基金净值增长率，业绩比较基准收益率是指业绩比较基准收益率。

3.本基金净值增长率是指基金净值增长率，业绩比较基准收益率是指业绩比较基准收益率。



姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
张俊英	本基金基金经理	2015-12-01	-	6

注：任基金经理满任职期限的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

2.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.曾任人任基金经理的公告日决定正式对外公告之日。证券从业的公告文本为行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	57,091,326.00	284
2	其中：股票	57,091,326.00	284
3	其中：债券	1,454,481,000.00	72.36
4	其中：货币	1,454,481,000.00	72.36
5	其中：衍生品	-	-
6	其中：其他	-	-
7	其中：其他	-	-
8	其中：其他	-	-
9	其中：其他	-	-
10	其中：其他	-	-

注：本基金资产净值未扣除与基金资产净值无关的费用和负债。

2.本基金资产净值未扣除与基金资产净值无关的费用和负债。

3.本基金资产净值未扣除与基金资产净值无关的费用和负债。

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	-	-
B	医药生物	-	-
C	信息技术	55,770,647.34	3.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,478,588	0.05
E	建筑业	775,274.28	0.05
F	采矿业	-	-
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	70,492.40	0.00
J	金融业	120,000.00	-
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	20,126.10	0.00
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	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
合计		57,091,326.00	3.55

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	000101	平安银行	863,900.00	15,744,000.00	0.82
2	000257	富临精工	192,000.00	7,800,562.00	0.48
3	002590	万安科技	232,100.00	7,235,271.00	0.45
4	300049	汇川技术	136,400.00	6,526,740.00	0.41
5	300322	洲明科技	350,600.00	5,558,575.15	0.33
6	002138	顺络电子	277,100.00	5,052,821.00	0.31
7	002418	康拓股份	465,400.00	4,971,440.00	0.31
8	300081	道明科技	147,000.00	4,574,400.00	0.27
9	300363	顺鑫农业	140,700.00	3,440,790.00	0.20
10	600411	中国铁建	37,090.00	775,274.28	0.05

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100000	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	100019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

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	160209	16国债09	299,400,000.00	18,631	0.00
2	160019	16国债10	1,000,000.00	99,400,000.00	0.00
3	100012	15国债11	800,000.00	99,400,000.00	0.00
4	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00
5	100550005	16年国开债05	500,000.00	51,155,000.00	0.00

3.	报告期内基金管理人对于提醒投资者及时终止申购发行公告,指定媒体公告时间为2016年4月18日。
4.	报告期内基金管理人对于淘宝网关闭申购服务进行公告,指定媒体公告时间为2016年5月5日。
5.	报告期内基金管理人对于网下交易支付渠道关闭及基金支付服务进行公告,指定媒体公告时间为2016年5月5日。
6.	报告期内基金管理人对于从业人员于公司网站发布不当言论进行公告,指定媒体公告时间为2016年5月21日。
5.	报告期内基金管理人对于本基金基金经理变更进行公告,指定媒体公告时间为2016年6月2日。

9.1 备查文件目录

§9 备查文件目录