

**国投瑞银创新动力混合型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告摘要**  
**2019 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

## 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |            |
|------------|--------------------|------------|
| 基金简称       | 国投瑞银创新动力混合         |            |
| 基金主代码      | 121005             |            |
| 交易代码       | 121005(前端)         | 128005(后端) |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |            |
| 基金合同生效日    | 2006 年 11 月 15 日   |            |
| 基金管理人      | 国投瑞银基金管理有限公司       |            |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司       |            |
| 报告期末基金份额总额 | 1,686,200,120.48 份 |            |
| 基金合同存续期    | 不定期                |            |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 通过投资主要以创新为原动力的优质上市公司的股票，分享企业成长带来的超额回报，实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | <p>本基金将借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验，根据中国市场的特特点，采取积极的投资管理策略。</p> <p>本基金战略资产配置比例遵循以下原则：</p> <p>1、战略资产配置</p> <p>（1） 股票组合投资比例：60—95%；</p> <p>（2） 除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%—40%；其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。</p> <p>2、股票投资管理</p> <p>本基金的股票投资决策，以自下而上的公司基本面分析为主。本基金借鉴 GEVS，以合适方法估计股票投资价值。构建（及调整）模拟组合，进行风险管理与归因分析。</p> <p>3、债券投资管理</p> <p>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。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，股票最低投资比例为 60%，属于预期风险收益较高的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金，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  | 中国光大银行股份有限公司        |                       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名            | 王明辉                 | 石立平                   |
|             | 联系电话          | 400-880-6868        | 010-63639180          |
|             | 电子邮箱          | service@ubssdic.com | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话      | 400-880-6868  | 95595               |                       |
| 传真          | 0755-82904048 | 010-63639132        |                       |

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层                                 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 62,795,529.23                        |
| 本期利润          | 194,418,229.88                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1167                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 23.16%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0168                               |
| 期末基金资产净值      | 1,043,665,014.13                     |
| 期末基金份额净值      | 0.6189                               |

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 3.48%    | 1.30%       | 4.37%      | 0.93%         | -0.89%  | 0.37% |
| 过去三个月      | -1.51%   | 1.53%       | -0.90%     | 1.22%         | -0.61%  | 0.31% |
| 过去六个月      | 23.16%   | 1.46%       | 21.47%     | 1.24%         | 1.69%   | 0.22% |
| 过去一年       | 9.89%    | 1.42%       | 8.21%      | 1.22%         | 1.68%   | 0.20% |
| 过去三年       | 13.54%   | 1.16%       | 17.58%     | 0.89%         | -4.04%  | 0.27% |
| 自基金合同生效起至今 | 264.09%  | 1.67%       | 153.07%    | 1.42%         | 111.02% | 0.25% |

注 1、本基金属于混合型基金，一般情况下，股票投资的比例大约为基金资产的 80%。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×80%+中债综合指数收益率×20%”。

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份额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

国投瑞银创新动力混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2006 年 11 月 15 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。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于 2002 年 6 月 13 日正式成立，注册资本 1 亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到 49% 的合资基金管理公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（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架构，以“诚信、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止 2019 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 67 只基金，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线。在专户理财业务方面，自 2008 年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII 等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自 2006 年开始为 QFII 信托计划提供投资咨询服务，具有丰

富经验，并于 2007 年获得 QDII 资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理（助理）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，基金投资部副总经理 | 2016-01-05      | -    | 9      | 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、国投瑞银创新动力混合型证券投资基金、国投瑞银品牌优势灵活配置混合型证券投资基金及国投瑞银精选收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 周思捷 | 本基金基金经理助理         | 2018-09-17      | -    | 7      | 中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司投资银行部分析员，国金证券股份有限公司研究所化工研究员，浦发银行总行风险政策部行业研究处研究员，国泰证券股份有限公司研究所化工研究员，2017 年 8 月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部，现任国投瑞银创新动力混合型证券投资基金基金经理助理。                      |

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合规守信情况的说明

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《国投瑞银创新动力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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，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，形成了有效地公平交易体系。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，社融增速逐步见底企稳，经济下行压力有所缓解。中美贸易战阶谈判波折前行，对经济的悲观预期有所修复，企业盈利继续寻底。地产销售和新开工有所下行，下半年预计维持下行趋势。随着猪价逐步走高，CPI 也将维持在相对高位。

1 季度 A 股市场呈现单边上涨走势，沪深 300、中证 1000 分别上涨 28.62%、33.44%，2 季度有所回撤，沪深 300、中证 1000 分别下跌 1.21%、9.98%，我们理解市场主要受经济见底预期、中美贸易谈判进程以及风险偏好等因素影响。风格上看，沪深 300 跑赢中证 1000 大约 7%。分行业看，食品饮料、非银行金融、农林牧渔、家电、计算机等涨幅居前。

本基金上半年维持中性偏高仓位，主要配置了食品、医药、电子、新能源车、农业、保险、超市等行业，基本都获得正回报；但从相对收益看，新能源车、电子明显跑输指数，关注下半年是否有拐点机会。

本基金将沿着产业变迁、股东回报、行业景气的思路，持有具备竞争优势的细分行业龙头，分享公司业绩成长，来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

截止本报告期末本基金份额净值为 0.6189 元，本报告期份额净值增长率 23.16%，同期业绩比较基准收益率为 21.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，地产销售和新开工有望缓慢下行，PPI 有望转负，周期性行业盈利有回落压力。中美贸易谈判进程是下半年影响经济和市场的重要变量，进而国内财政和货币政策也会相机抉择。下半年股票市场预期收益率相对上半年会大幅降低，但市场目前也看不到系统性风险。

本基金继续保持中性偏高仓位，行业配置以食品、医药、电子、新能源车、农业、保险、超市等行业为主，个股以持有各个细分子行业的龙头公司为主。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程，监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为 62,795,529.23 元，期末可供分配利润为 28,274,681.85 元。本基金本期未实施利润分配。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国投瑞银创新动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国投瑞银创新动力混合型证券投资基金 2019 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银创新动力混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      | -                              | -                                |
| 银行存款            | 90,391,908.49                  | 121,645,313.71                   |
| 结算备付金           | 1,675,801.53                   | 1,859,670.93                     |
| 存出保证金           | 523,650.99                     | 919,464.61                       |
| 交易性金融资产         | 946,625,042.17                 | 641,570,549.85                   |
| 其中：股票投资         | 940,514,579.74                 | 641,570,549.85                   |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 6,110,462.43                   | -                                |
| 资产支持证券投资        | -                              | -                                |
| 贵金属投资           | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                              | 49,000,193.50                    |
| 应收证券清算款         | 7,181,853.72                   | -                                |
| 应收利息            | 23,129.34                      | 67,382.47                        |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 281,650.00                     | 58,843.34                        |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     | <b>1,046,703,036.24</b>        | <b>815,121,418.41</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      | -                              | -                                |
| 短期借款            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         | -                              | 1,408,478.31                     |
| 应付赎回款           | 314,863.66                     | 36,770.92                        |
| 应付管理人报酬         | 1,245,426.11                   | 1,054,981.94                     |
| 应付托管费           | 207,571.01                     | 175,830.32                       |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 901,690.08                     | 894,599.58                       |
| 应交税费            | 39.35                          | 1.10                             |
| 应付利息            | -                              | -                                |
| 应付利润            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         | -                              | -                                |
| 其他负债            | 368,431.90                     | 530,063.68                       |
| <b>负债合计</b>     | <b>3,038,022.11</b>            | <b>4,100,725.85</b>              |
| <b>所有者权益：</b>   | -                              | -                                |
| 实收基金            | 1,015,390,332.28               | 971,851,885.15                   |
| 未分配利润           | 28,274,681.85                  | -160,831,192.59                  |

|            |                         |                       |
|------------|-------------------------|-----------------------|
| 所有者权益合计    | <b>1,043,665,014.13</b> | <b>811,020,692.56</b> |
| 负债和所有者权益总计 | <b>1,046,703,036.24</b> | <b>815,121,418.41</b> |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.6189 元，基金份额总额 1,686,200,120.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银创新动力混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           | <b>205,627,259.13</b>                    | <b>-54,419,784.16</b>                         |
| 1.利息收入                | 583,226.29                               | 1,294,127.90                                  |
| 其中：存款利息收入             | 535,356.96                               | 686,978.43                                    |
| 债券利息收入                | 4,360.24                                 | 97,804.64                                     |
| 资产支持证券利息收入            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            | 43,509.09                                | 509,344.83                                    |
| 其他利息收入                | 0.00                                     | 0.00  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 73,365,339.10                            | -17,572,530.28                                |
| 其中：股票投资收益             | 65,290,844.45                            | -22,900,499.39                                |
| 基金投资收益                | -  | -   |
| 债券投资收益                | -  | 669,586.47                                    |
| 资产支持证券投资收益            | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | -  | -   |
| 衍生工具收益                | -  | -   |
| 股利收益                  | 8,074,494.65                             | 4,658,382.64                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 131,622,700.65                           | -38,180,915.26                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 55,993.09                                | 39,533.48                                     |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>11,209,029.25</b>                     | <b>16,221,326.46</b>                          |
| 1. 管理人报酬              | 7,248,296.86                             | 7,344,414.81                                  |
| 2. 托管费                | 1,208,049.47                             | 1,224,069.16                                  |
| 3. 销售服务费              | -  | -   |
| 4. 交易费用               | 2,615,961.58                             | 7,445,800.25                                  |
| 5. 利息支出               | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出         | -  | -   |
| 6. 税金及附加              | 14.41                                    | 4.95  |
| 7. 其他费用               | 136,706.93                               | 207,037.29                                    |

|                     |                |                |
|---------------------|----------------|----------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 194,418,229.88 | -70,641,110.62 |
| 减：所得税费用             | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 194,418,229.88 | -70,641,110.62 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银创新动力混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日      |                 |                  |
|--|--|-----------------|------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 971,851,885.15                             | -160,831,192.59 | 811,020,692.56   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 194,418,229.88  | 194,418,229.88   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 43,538,447.13                              | -5,312,355.44   | 38,226,091.69    |
| 其中：1.基金申购款                             | 134,703,288.72                             | -3,917,041.02   | 130,786,247.70   |
| 2.基金赎回款                                | -91,164,841.59                             | -1,395,314.42   | -92,560,156.01   |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -               | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,015,390,332.28                           | 28,274,681.85   | 1,043,665,014.13 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,005,791,741.95                           | 39,174,270.72   | 1,044,966,012.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -70,641,110.62  | -70,641,110.62   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -24,086,569.01                             | -962,105.87     | -25,048,674.88   |
| 其中：1.基金申购款                             | 61,130,243.29                              | -421,995.43     | 60,708,247.86    |

|  |                |                |                |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 2.基金赎回款                                | -85,216,812.30 | -540,110.44    | -85,756,922.74 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | -31,127,051.90 | -31,127,051.90 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 981,705,172.94 | -63,555,997.67 | 918,149,175.27 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘凯，主管会计工作负责人：刘凯，会计机构负责人：冯伟

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国投瑞银创新动力混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原名国投瑞银创新动力股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]189号文《关于同意国投瑞银创新动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2006年11月15日正式生效,首次设立募集规模为1,496,913,854.64份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,注册登记人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“中国光大银行”)。

于2007年4月9日(拆分日),本基金管理人国投瑞银基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币1.6606元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第10位为人民币1.6605941011元。本基金管理人于拆分日,按照1:1.6605941011的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额面值为人民币0.6022元。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》及本基金合同的有关规定,经协商本基金托管人同意,并报中国证监会备案,本基金管理人于2015年8月6日将本基金由“国投瑞银创新动力股票型证券投资基金”更名为“国投瑞银创新动力混合型证券投资基金”,其对应基金简称更名为“国投瑞银创新动力混合”。上述变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、

债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票组合投资占基金资产的 60-95%；除股票资产以外的其他资产投资占基金资产的 5%-40%；其中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%。在股票投资方面，本基金将采取筛选创新能力显著的优质企业股票的选股思路。80%以上的非现金基金资产将投资于创新能力显著的优质企业。

鉴于中信标普指数信息服务有限公司固定收益系列指数于 2015 年 9 月 30 日停止发布，为保护基金份额持有人的合法权益，以更科学、合理的业绩比较基准评价基金的业绩表现，本基金管理人于 2015 年 8 月 6 日对本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数×80%+中信标普全债指数×20%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%”。上述变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

### 6.4.6 税项

#### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

#### (2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等



增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。根据上海市虹口区税务局规定，地方教育费附加的税率于 2018 年 7 月 1 日起由之前的 2%调整为 1%，自 2019 年 7 月 1 日起费率恢复至 2%。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### (3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

|                      |                     |
|----------------------|---------------------|
| 国投瑞银基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（“光大银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6<br>月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,248,296.86                   | 7,344,414.81                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,225,325.86                   | 1,304,928.46                        |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,208,049.47                   | 1,224,069.16                        |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人复核后于次

月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间，均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间本基金基金管理人均未运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30<br>日 |               | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30<br>日 |                |
|-------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|----------------|
|       | 期末余额                           | 当期利息收入        | 期末余额                                | 当期利息收入         |
|       | 中国光大银行                         | 90,391,908.49 | 511,909.27                          | 284,607,909.24 |

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |        |        |            |              |              |    |
|---------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|------------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 300310              | 宜通世纪 | 2017-07-07 | 2019-07-12 | 非公开发行  | 10.95  | 7.25   | 319,635.00 | 3,500,003.25 | 2,317,353.75 | -  |
| 002952              | 亚世光电 | 2019-03-20 | 2020-03-28 | 新股锁定   | 20.76  | 31.14  | 35,509.00  | 737,177.22   | 1,105,750.26 | -  |
| 601236              | 红塔证券 | 2019-06-26 | 2019-07-05 | 新股未上市  | 3.46   | 3.46   | 9,789.00   | 33,869.94    | 33,869.94    | -  |
| 300788              | 中信出版 | 2019-06-27 | 2019-07-05 | 新股未上市  | 14.85  | 14.85  | 1,556.00   | 23,106.60    | 23,106.60    | -  |
| 6.4.9.1.2 受限证券类别：债券 |      |            |            |        |        |        |            |              |              |    |
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：张)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 113538              | 安图转债 | 2019-06-28 | 2019-07-22 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 1,620.00   | 161,998.93   | 161,998.93   | -  |

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 940,514,579.74   | 89.85         |
|    | 其中：股票             | 940,514,579.74   | 89.85         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 6,110,462.43     | 0.58          |
|    | 其中：债券             | 6,110,462.43     | 0.58          |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 92,067,710.02    | 8.80          |
| 8  | 其他各项资产            | 8,010,284.05     | 0.77          |
| 9  | 合计                | 1,046,703,036.24 | 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。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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         | 50,556,718.96  | 4.84          |
| B  | 采矿业              | 363,431.25     | 0.03          |
| C  | 制造业              | 492,587,888.85 | 47.20         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -             |
| E  | 建筑业              | -              | -             |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 135,817,135.98 | 13.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 27,139,270.00  | 2.60  |
| H | 住宿和餐饮业          | 6,526,740.00   | 0.63  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 55,921,824.76  | 5.36  |
| J | 金融业             | 130,690,789.16 | 12.52 |
| K | 房地产业            | 32,728,392.38  | 3.14  |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 8,159,281.80   | 0.78  |
| 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       | 23,106.60      | 0.00  |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 940,514,579.74 | 90.12 |

### 7.2.2 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。

### 7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)        | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|--------------|
| 1  | 603517 | 绝味食品 | 2,383,214.00 | 92,730,856.74 | 8.89         |
| 2  | 300232 | 洲明科技 | 8,457,940.00 | 81,872,859.20 | 7.84         |
| 3  | 603228 | 景旺电子 | 1,876,781.00 | 75,090,007.81 | 7.19         |
| 4  | 601336 | 新华保险 | 1,232,874.00 | 67,845,056.22 | 6.50         |
| 5  | 603368 | 柳药股份 | 1,538,228.00 | 50,576,936.64 | 4.85         |
| 6  | 300498 | 温氏股份 | 1,409,836.00 | 50,556,718.96 | 4.84         |
| 7  | 603708 | 家家悦  | 2,004,237.   | 45,736,688.34 | 4.38         |

|    |        |      |              |               |      |
|----|--------|------|--------------|---------------|------|
|    |        |      | 00           |               |      |
| 8  | 601933 | 永辉超市 | 3,869,100.00 | 39,503,511.00 | 3.79 |
| 9  | 300037 | 新宙邦  | 1,619,966.00 | 33,760,091.44 | 3.23 |
| 10 | 603659 | 璞泰来  | 684,336.00   | 32,177,478.72 | 3.08 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601336 | 新华保险 | 41,811,972.40 | 5.16            |
| 2  | 300232 | 洲明科技 | 40,959,554.81 | 5.05            |
| 3  | 000001 | 平安银行 | 37,405,291.32 | 4.61            |
| 4  | 000961 | 中南建设 | 34,792,748.60 | 4.29            |
| 5  | 603228 | 景旺电子 | 33,744,730.47 | 4.16            |
| 6  | 601398 | 工商银行 | 30,788,596.18 | 3.80            |
| 7  | 603885 | 吉祥航空 | 29,667,492.19 | 3.66            |
| 8  | 300170 | 汉得信息 | 28,636,840.73 | 3.53            |
| 9  | 603517 | 绝味食品 | 27,874,079.51 | 3.44            |
| 10 | 601933 | 永辉超市 | 25,944,952.00 | 3.20            |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 24,525,709.00 | 3.02            |
| 12 | 002157 | 正邦科技 | 24,200,006.00 | 2.98            |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 24,062,006.50 | 2.97            |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 23,665,797.30 | 2.92            |
| 15 | 300558 | 贝达药业 | 21,623,971.00 | 2.67            |
| 16 | 603583 | 捷昌驱动 | 20,683,677.40 | 2.55            |
| 17 | 000063 | 中兴通讯 | 19,657,030.18 | 2.42            |
| 18 | 002407 | 多氟多  | 18,751,146.96 | 2.31            |
| 19 | 000333 | 美的集团 | 18,329,462.20 | 2.26            |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 18,107,997.00 | 2.23            |
| 21 | 002912 | 中新赛克 | 16,892,222.40 | 2.08            |

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 002157 | 正邦科技 | 44,940,857.27 | 5.54            |
| 2  | 002737 | 葵花药业 | 39,493,690.80 | 4.87            |
| 3  | 600038 | 中直股份 | 37,734,731.00 | 4.65            |
| 4  | 601601 | 中国太保 | 32,673,295.80 | 4.03            |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 29,651,894.38 | 3.66            |
| 6  | 603868 | 飞科电器 | 28,524,165.35 | 3.52            |
| 7  | 600563 | 法拉电子 | 27,775,732.00 | 3.42            |
| 8  | 000063 | 中兴通讯 | 23,540,134.04 | 2.90            |
| 9  | 000001 | 平安银行 | 21,317,471.82 | 2.63            |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 21,124,907.20 | 2.60            |
| 11 | 002407 | 多氟多  | 20,815,811.53 | 2.57            |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 19,222,129.00 | 2.37            |
| 13 | 601336 | 新华保险 | 19,026,823.00 | 2.35            |
| 14 | 603259 | 药明康德 | 18,323,462.32 | 2.26            |
| 15 | 300568 | 星源材质 | 16,802,244.60 | 2.07            |
| 16 | 002714 | 牧原股份 | 15,829,588.00 | 1.95            |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 15,694,624.86 | 1.94            |
| 18 | 300558 | 贝达药业 | 15,143,231.00 | 1.87            |
| 19 | 600885 | 宏发股份 | 13,892,385.78 | 1.71            |
| 20 | 300136 | 信维通信 | 12,443,205.44 | 1.53            |

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 930,249,306.30 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 826,883,317.57 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|---------|
|----|------|------|---------|



|    |           |              | 比例(%) |
|----|-----------|--------------|-------|
| 1  | 国家债券      | -            | -     |
| 2  | 央行票据      | -            | -     |
| 3  | 金融债券      | -            | -     |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -     |
| 4  | 企业债券      | -            | -     |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -     |
| 6  | 中期票据      | -            | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 6,110,462.43 | 0.59  |
| 8  | 同业存单      | -            | -     |
| 9  | 地方政府债     | -            | -     |
| 10 | 其他        | -            | -     |
| 11 | 合计        | 6,110,462.43 | 0.59  |

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张)  | 公允价值         | 占基金资产<br>净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|------------------|
| 1  | 113529 | 绝味转债 | 46,130 | 5,948,463.50 | 0.57             |
| 2  | 113538 | 安图转债 | 1,620  | 161,998.93   | 0.02             |

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中，持有“新华保险”市值 67,845,056.22 元，占基金资产净值 6.50%。根据中国保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监保罚决字〔2018〕1 号），新华保险股份有限公司因欺骗投保人、编制提供虚假资料、未按照规定使用经批准或备案的保险费率等行为，被中国保险监督管理委员会分别罚款 30 万元、罚款 50 万元、罚款 30 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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 523,650.99   |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,181,853.72 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 23,129.34    |
| 5  | 应收申购款   | 281,650.00   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 8,010,284.05 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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的情况。

#### 7.12.6 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。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构          |            |                      |            |
|----------|---------------|----------------|------------|----------------------|------------|
|          |               | 机构投资者          |            | 个人投资者                |            |
|          |               | 持有份额           | 占总份<br>额比例 | 持有份额                 | 占总份<br>额比例 |
| 35,187   | 47,921.11     | 167,549,130.32 | 9.94%      | 1,518,650,990.1<br>6 | 90.06%     |

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 530.94    | 0.00%    |

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式                      | 0                 |

|    |  |
|----|--|
| 基金 |  |
|----|--|

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，本基金基金经理于本报告期末均未持有本基金份额。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2006 年 11 月 15 日）基金份额总额 | 1,496,913,854.64 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 1,613,890,562.80 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 223,700,675.50   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 151,391,117.82   |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 1,686,200,120.48 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

1、自 2019 年 5 月 15 日起，刘凯先生任公司副总经理、代任公司总经理职务，并  
不再担任公司督察长；自同日起，王彬女士任期届满不再担任公司总经理；

2、自 2019 年 6 月 5 日起，王明辉先生任公司督察长。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金基金投资策略未发生变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金继续聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 光大证券 | 1      | 244,970,540.21 | 13.97%       | 228,142.35 | 13.97%     | -  |
| 国都证券 | 1      | 213,848,265.28 | 12.19%       | 199,157.49 | 12.19%     | -  |
| 招商证券 | 1      | 203,453,751.93 | 11.60%       | 189,476.99 | 11.60%     | -  |
| 国盛证券 | 1      | 192,171,824.21 | 10.96%       | 178,970.28 | 10.96%     | -  |
| 申银万国 | 2      | 187,527,481.28 | 10.69%       | 174,645.72 | 10.69%     | -  |
| 长城证券 | 1      | 146,752,236.37 | 8.37%        | 136,670.00 | 8.37%      | -  |
| 万联证券 | 1      | 138,435,097.14 | 7.89%        | 128,924.25 | 7.89%      | -  |
| 广发证券 | 1      | 126,939,721.51 | 7.24%        | 118,217.99 | 7.24%      | -  |
| 华泰证券 | 1      | 124,551,600.99 | 7.10%        | 115,994.15 | 7.10%      | -  |
| 国泰君安 | 2      | 123,416,679.87 | 7.04%        | 114,937.30 | 7.04%      | -  |
| 国信证券 | 1      | 51,909,744.04  | 2.96%        | 48,343.55  | 2.96%      | -  |

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期未发生债券交易、回购交易及权证交易。

3、本基金本报告期交易席位未发生变化。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日