

## 国投瑞银融华债券型证券投资基金

## [2013] 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:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2013年7月18日

重要提示

基金管理人和基金托管人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，并对本内容的真实性、准确性、完整性和及时性负责。

基金托管人中国光大银行股份有限公司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，并对本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金投资者承担诚实信用、勤勉尽责的管理责任和投资以资产净值为基础,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。

本报告不构成财务投资建议。

本报告出自2013年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银融华债券

基金主代码 121001

交易代码 前端:121001;后端:128001

基金运作方式 约期型开放式

基金合同生效日 2003年1月16日

报告期末基金份额总额 442,836,053.64份

投资目标 追求低风险的稳定收益,即以债券投资为主,稳健型股票投资为辅,在有效控制风险的前提下,谋求基金投资收益长期稳定增长。

投资对象 以国债、金融债和包括可转债在内的AAA级企业债

为,以稳健收益为投资目标,为债券投资较少于基金净资产净值的40%。持仓比例在股票类资产范围是40~95%,股票投资的最大比例不超过40%,持仓比例在股票类资产范围是0~40%。除了预期有

的趋势变化外,原则上股票投资比例限制在20%以内。具体

投资策略 投资策略

1. 采取主动的和被动的分析方法,对资产配置进行持续提供指

导,重点关注和利率趋势变化,对资产配置进行动态调整和证券市

场环境变化,主动调整债券资产配置及其投资比例。

2. 根据收益、风险、流动性风险匹配原则以及证券的低估值

原则进行资产组合,合理配置不同市场和不同投资工具的投资

比例,并根据投资环境的变化适时调整。

3. 选择具有稳定收益回报的股票、无风险利率和参与一级

市场的股票、货币市场工具、风险利率风险,增加盈利机会。

4. 投资策略

估计对冲合理价值,根据合理价值与市场价格间的

差幅(价值/价格)以及权证价值对价值参数的敏感性,结合持有的股票平均价值量,决策买入、持有或沽出权证。

5. 在将来衍生工具市场得到发展的情况下,本基金将使用

衍生产品市场,增加投资品种,并把握投资机会。

6. 报告期末未持有股票。

7. 报告期内未按行业分类的股票投资组合

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十名股票投资明细

9. 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债券投资组合

10. 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组合

11. 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贵金属投资组合

12. 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型基金投资组合

13. 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债券型基金投资组合

14. 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货币市场基金投资组合

15. 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权证投资组合

16. 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基金投资组合

17. 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其他投资组合

18. 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组合

19. 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贵金属投资组合

20. 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型基金投资组合

21. 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债券型基金投资组合

22. 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货币市场基金投资组合

23. 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权证投资组合

24. 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基金投资组合

25. 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其他投资组合

26. 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组合

27. 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贵金属投资组合

28. 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型基金投资组合

29. 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债券型基金投资组合

30. 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货币市场基金投资组合

31. 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权证投资组合

32. 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基金投资组合

33. 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其他投资组合

34. 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组合

35. 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贵金属投资组合

36. 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型基金投资组合

37. 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债券型基金投资组合

38. 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货币市场基金投资组合

39. 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权证投资组合

40. 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基金投资组合

41. 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其他投资组合

42. 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组合

43. 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贵金属投资组合

44. 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型基金投资组合

45. 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债券型基金投资组合

46. 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货币市场基金投资组合

47. 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权证投资组合

48. 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基金投资组合

49. 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其他投资组合

50. 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组合

51. 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贵金属投资组合

52. 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型基金投资组合

53. 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债券型基金投资组合

54. 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货币市场基金投资组合

55. 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权证投资组合

56. 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基金投资组合

57. 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其他投资组合

58. 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组合

59. 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贵金属投资组合

60. 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型基金投资组合

61. 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债券型基金投资组合

62. 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货币市场基金投资组合

63. 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权证投资组合

64. 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基金投资组合

65. 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其他投资组合

66. 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组合

67. 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贵金属投资组合

68. 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型基金投资组合

69. 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债券型基金投资组合

70. 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货币市场基金投资组合

71. 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权证投资组合

72. 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基金投资组合

73. 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其他投资组合

74. 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组合

75. 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贵金属投资组合

76. 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型基金投资组合

77. 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债券型基金投资组合

78. 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货币市场基金投资组合

79. 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权证投资组合

80. 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基金投资组合

81. 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其他投资组合

82. 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组合

83. 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贵金属投资组合

84. 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型基金投资组合

85. 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债券型基金投资组合

86. 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货币市场基金投资组合

87. 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权证投资组合

88. 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基金投资组合

89. 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其他投资组合

90. 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组合

91. 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贵金属投资组合

92. 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型基金投资组合

93. 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债券型基金投资组合

94. 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货币市场基金投资组合

95. 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权证投资组合

96. 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基金投资组合

97. 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其他投资组合

98. 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组合

99. 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贵金属投资组合

100. 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型基金投资组合

101. 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债券型基金投资组合

102. 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货币市场基金投资组合

103. 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权证投资组合

104. 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基金投资组合

105. 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其他投资组合

106. 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组合

107. 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贵金属投资组合

108. 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型基金投资组合

109. 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债券型基金投资组合

110. 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货币市场基金投资组合

111. 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权证投资组合

112. 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基金投资组合

113. 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其他投资组合

114. 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组合

115. 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贵金属投资组合

116. 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型基金投资组合

117. 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债券型基金投资组合