

国投瑞银纯债债券型证券投资基金

2013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:2013年7月18日

\$1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,复核无误后予以公告。误导致基金一定盈利。

基金管理人的过往业绩并不代表其未来表现,勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告书由2013年4月1日起至2013年3月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银纯债债券

交易代码 121013 级别 短期开放式

基金合同生效日 2012年12月11日

报告期末基金份额总额 306,449,558.31

投资目标 本基金在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争在长期中实现超越业绩比较基准的投资业绩,为投资者提供低风险、稳健回报的理财产品。

本基金的投资目标是具有良好的流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、信用债(即企业债、公司债、分离债存续债、次级债)、短期融资券、资产支持证券、地方政府债券、非公开募集的债券型基金、国家政策性银行债券、收益凭证、货币市场基金、债券型基金、货币型基金以及符合监管机构或中国证监会规定的其他投资基金品种。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%;持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金不可参与转售(不含可分离债券)投资,不参与股票二级市场投资,也不进行二级市场股票、权证投资。

业绩比较基准 中债综合指数收益率

风险收益特征 本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司

中国银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 国投瑞银纯债债券A 国投瑞银纯债债券B

下属两级基金的交易代码 121013 128013

报告期末下属两级基金的份额总额 180,497,096.23 125,952,462.08

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年04月01日-2013年06月30日)

国投瑞银纯债债券A 国投瑞银纯债债券B

1.本期已实现收益 3,160,014.52 2,125,571.76

2.本期利润 2,340,311.57 1,556,029.49

3.加权平均基金份额本期利润 0.0091 0.0096

4.期末基金资产净值 180,485,428.20 126,052,506.96

5.期末基金份额净值 1.000 1.001

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.本期利润不包括可供出售金融资产公允价值变动损益,未考虑扣除非经常性损益影响。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.80% 0.12% 0.12% 0.11% 0.68% 0.01%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注2:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.2 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注3:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.3 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.80% 0.12% 0.12% 0.11% 0.68% 0.01%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注4:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.4 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注5:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.5 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.80% 0.12% 0.12% 0.11% 0.68% 0.01%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注6:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.6 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注7:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.7 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.80% 0.12% 0.12% 0.11% 0.68% 0.01%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注8:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.8 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注9:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.9 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注10:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.10 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注11:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.11 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注12:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.12 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券B

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注13:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合型基金和股票型基金。本基金选取中债综合指数收益率作为本基金业绩比较基准的比

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.本基金合同生效日为2012年12月11日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.13 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银纯债债券A

阶段 净值增长率① 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

过去三个月 0.90% 0.13% 0.12% 0.11% 0.78% 0.02%

注14:本基金为纯债型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市

场基金、混合