

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

[2013] 年度报告摘要

单位:人民币元

1.1 重要提示及目录

基金管理人的承诺:本基金所披露的信息不存在虚假记载、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。基金管理人已就基金合同中基金的名称、基金的类别、基金的运作方式、基金的存续期限、基金的规模、基金的收益与损失、基金的会计核算、投资目标、投资范围、投资策略、基金的费用、收益分配、风险提示、财务会计报告、投资组合报告、基金净值公告、基金定期报告、基金临时报告、基金产品资料概要、基金合同的变更、终止和清算等事项做了充分的说明。基金合同是基金投资者与基金管理人之间关于基金的法律文件,对基金投资者和基金管理人具有同等的法律约束力。本年度报告摘要仅能对年度报告全文进行简述,投资者欲了解详细信息,应阅读年度报告全文。

基金管理人于2013年1月1日至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金概况		国投瑞银量化增强债券
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
基金合同签订日	2006年9月16日	
基金募集日期	2006年9月16日	
基金投资人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金类别	中长期纯债型	
基金合同生效日期	313,000,940.00(注)	
基金存续期间	不固定	
基金分级后的基金简称	国投瑞银量化增强债券A/B	国投瑞银量化增强债券C
基金合同生效日期	12,002,000.00(注)	12,012
基金份额净值	1.2010(1.04)	1.2012
报告期末基金份额的总额	252,468,076.49	60,21,864,060

2.1 基金基本情况

投资目标		在追求基金资产稳定性、有控制风险和保持基金流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人创造稳定的收入。
基金的投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、企业债、公司债、金融债、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可分离交易的公司债券、资产支持证券、信用债、可转换债券(含可分离交易的可转债)、可交换债券、公募REITs、同业存单、央行票据、货币市场基金、国债逆回购、银行存款、货币市场工具、现金等。	
投资策略	本基金主要投资于债券类资产,其中债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中信用类债券的比例不超过基金资产的30%。持有到期策略:本基金将根据宏观经济形势、资金面情况、利率走势、信用利差、信用评级等因素,综合分析判断,择机调整组合久期,并根据预期收益率的合理性,适时调整组合的久期,以达到在不同时间段内获得稳定收益的目的。	
业绩比较基准	本基金对债券资产的平均回报比不超过基金净资产的80%,股票、权证类投资资产的比例不超过基金净资产的20%。其中信用类债券的3%持有到期收益减去信用利差,即为本基金的业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属中低风险品种,预期收益高于货币型基金,低于股票型基金。	

2.2 基品说明

投资目标		在追求基金资产稳定性、有控制风险和保持基金流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争在有效控制风险的前提下,为基金份额持有人创造稳定的收入。
基金的投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、企业债、公司债、金融债、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可分离交易的公司债券、资产支持证券、信用债、可转换债券(含可分离交易的可转债)、可交换债券、公募REITs、同业存单、央行票据、货币市场基金、国债逆回购、银行存款、货币市场工具、现金等。	
投资策略	本基金主要投资于债券类资产,其中债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中信用类债券的比例不超过基金资产的30%。持有到期策略:本基金将根据宏观经济形势、资金面情况、利率走势、信用利差、信用评级等因素,综合分析判断,择机调整组合久期,并根据预期收益率的合理性,适时调整组合的久期,以达到在不同时间段内获得稳定收益的目的。	
业绩比较基准	本基金对债券资产的平均回报比不超过基金净资产的80%,股票、权证类投资资产的比例不超过基金净资产的20%。其中信用类债券的3%持有到期收益减去信用利差,即为本基金的业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属中低风险品种,预期收益高于货币型基金,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	中国建设银行股份有限公司

2.4 信息披露方式

披露时间	披露网站	披露方式
每年年度报告	http://www.gtfund.com	公告、电子邮件、公告网站、公告客户端

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

基金单位:人民币元		
3.1.1 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期实现收益	23,431,935.65	8,946,399.14
本期利润	8,327,609.83	30,851,386.59
加权平均基金份额利润	0.0265	0.0046
期末可供分配基金份额利润	1.90%	-6.38%
3.1.2 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	-0.0041	-0.0049
本期可供分配利润	262,811,727.26	367,738,113.87
期末基金份额净值	1.001	0.998
3.1.3 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.4 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.5 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.6 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.7 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.8 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.9 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.10 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.11 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.12 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.13 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.14 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.15 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.16 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,038.45	4,750,832.84
本期利润	6,019,109.24	22,238,801.10
本期可供分配利润	0.0200	-0.0017
期末可供分配利润	1.90%	-6.38%
3.1.17 相关数据和指标		
2013年 2012年 2011年		
本期利润	8,855,03	