国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银优化增强债券	
基金主代码	121012	
交易代码	121012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年09月08日	
报告期末基金份额总额	1,070,747,351.65份	
投资目标	在追求基金资产稳定增值,有效控制风险和保持资金流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	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债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。 本基金既可以参与一级市场新股申购或增发新股,也可以在二级市场买入股票、权证等权益类资产。 本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中权证投资的比例不超过基金资产净值的3%;持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,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	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银优化增强债券A/B	国投瑞银优化增强债券C
下属分级基金的交易代码	121012	128112
报告期末下属分级基金的份额总额	780,658,749.21份	290,088,602.44份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)	
	国投瑞银优化增强债券A/B	国投瑞银优化增强债券C
1.本期已实现收益	-1,280,326.26	-419,699.30
2.本期利润	-4,210,131.75	-7,489,752.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.0417
4.期末基金资产净值	1,154,955,287.51	428,289,966.92
5.期末基金份额净值	1.479	1.476

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、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 本报告期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

国投瑞银优化增强债券A/B

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.75%	0.53%	-1.83%	0.35%	2.58%	0.18%

国投瑞银优化增强债券C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.61%	0.54%	-1.83%	0.35%	2.44%	0.19%

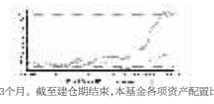
注:1、本基金以中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%作为业绩比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,具有权威性,适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

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

国投瑞银优化增强债券A/B

国投瑞银优化增强债券C



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李怡文	本基金基金经理、固定收益部副总监	2010年09月08日		14	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任Pinkey Bevy Investment Company分析师,中国建设银行(香港)资产组合经理。2008年6月加入国投瑞银,现任国投瑞银优化增强债券基金、国投瑞银瑞信保本混合基金、国投瑞银纯债基金、国投瑞银新机遇混合基金、国投瑞银岁增利基金和和国投瑞银财财保本基金基金经理。
狄晓娟	本基金基金经理	2015年06月27日		6	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2010年7月加入国投瑞银。2015年6月27日起担任国投瑞银优化增强债券基金基金经理。

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《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遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银优化增强债券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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以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,形成了有效的公平交易体系。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 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末(2015年9月30日),本基金A级份额净值为1.479元,C级份额净值为1.476元,本报告期A级份额净值增长率为0.75%,C级份额净值增长率为0.61%,同期业绩比较基准收益率为-1.83%,基金净值增长率高于业绩基准的主要原因是对权益类资产的仓位控制较好。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,经济增长乏力,通胀压力有限的情景下,货币政策仍将维持宽松。债券市场收益率经过3季度的大幅下行后,进一步下行空间相对有限。本基金在债券投资方面,仍将精选个券,将选择适当的时机拉长组合久期。经过3季度的大幅调整,股票市场的风险得到一定程度的释放,本基金将维持一定比例的股票资产配置,重点精选估值合理、基本面平稳的个股。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	205,926,407.50	12.81
	其中:股票	205,926,407.50	12.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,311,434,868.02	81.61
	其中:债券	1,311,434,868.02	81.61
	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	29,988,564.98	1.87
	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	39,459,467.67	2.46
8	其他资产	20,182,575.41	1.26
9	合计	1,606,991,883.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	19,447,655.94	1.23
C	制造业	135,373,216.58	8.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,493,632.00	0.98
E	建筑业	817,800.00	0.05
F	批发和零售业	21,140,122.64	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	13,653,980.34	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	205,926,407.50	13.01

5.3 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

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	000028	国药一致	374,692	21,140,122.64	1.34
2	600028	中国石化	4,102,881	19,447,655.94	1.23
3	000958	东方能源	586,880	15,493,632.00	0.98
4	600594	益佰制药	877,100	13,919,577.00	0.88
5	000089	深圳机场	2,143,482	13,653,980.34	0.86
6	000401	冀东水泥	1,595,600	13,562,600.00	0.86
7	000999	华润三九	580,361	13,522,411.30	0.85
8	600469	风神股份	1,036,200	13,366,980.00	0.84
9	600612	老凤祥	281,400	13,034,448.00	0.82
10	002422	科伦药业	706,700	10,522,763.00	0.66

5.4 报告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	59,789,426.90	3.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	64,103,888.40	4.05
	其中:政策性金融债	64,103,888.40	4.05
4	企业债券	275,938,552.72	17.43
5	企业短期融资券	762,477,000.00	48.16
6	中期票据	149,126,000.00	9.42
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,311,434,868.02	82.83

5.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	011599165	15国药控股SCP001	600,000	60,534,000.00	3.82
2	011599064	15泸州老SCP001	600,000	60,474,000.00	3.82
3	101474010	14北控集MTN003	500,000	53,140,000.00	3.36
4	011519001	15国电SCP001	500,000	50,345,000.00	3.18
5	011586007	15光明SCP007	500,000	50,080,000.00	3.16

5.6 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	642,625.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,399,426.76
5	应收申购款	140,523.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,182,575.41

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	国投瑞银优化增强债券A/B	国投瑞银优化增强债券C
报告期期初基金份额总额	699,271,382.48	304,282,644.31
报告期间基金总申购份额	379,853,714.38	363,647,276.91
减:报告期间基金总赎回份额	298,466,347.65	377,841,318.78
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	780,658,749.21	290,088,602.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内基金管理人对公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜进行公告,指定媒体公告时间为2015年7月6日。

2.报告期内基金管理人对本基金分红进行公告,指定媒体公告时间分别为2015年8月12日,2015年9月11日。

3.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为2015年9月10日。

4.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为2015年9月10日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银增利宝货币市场基金注册的批复》(证监许可[2014]1125号)

《关于国投瑞银增利宝货币市场资基金备案确认的函》(证券基金机构监管部部函[2014]1756号)

《国投瑞银增利宝货币市场基金基金合同》

《国投瑞银增利宝货币市场基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银增利宝货币市场基金2015年第三季度报告原文

9.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028 号荣超经贸中心46 层

存放网址:http://www.ubssdic.com

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

咨询电话:国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一五年十月二十六日

国投瑞银增利宝货币市场基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:渤海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银增利宝货币	
基金主代码	000868	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年11月13日	
报告期末基金份额总额	2,860,190,237.58份	
投资目标	本基金以基金资产安全性、流动性为先,并力争实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金主要采用流动性管理策略、资产配置策略,并适当利用交易策略,进行积极的投资组合管理。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期风险和预期收益率均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投增利宝货币A	国投增利宝货币B
下属分级基金的交易代码	000868	000869
报告期末下属分级基金的份额总额	106,154,197.27份	2,754,036,040.31份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)	
	国投增利宝货币A	国投增利宝货币B
1.本期已实现收益	717,467.59	20,337,291.79
2.本期利润	717,467.59	20,337,291.79
3.期末基金资产净值	106,154,197.27	2,754,036,040.31

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金根据每日基金收益情况以每万份基金收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.国投增利宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.8699%	0.0037%	0.3456%	0.0000%	0.5243%	0.0037%

2.国投增利宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.8699%	0.0037%	0.3456%	0.0000%	0.5243%	0.0037%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投增利宝货币A

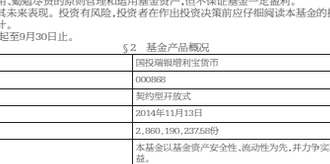
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年11月13日-2015年09月30日)

国投增利宝货币B

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年11月13日-2015年09月30日)



注:1.本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至本报告期末,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。

2.本基金合同生效日为2014年11月13日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐栋	本基金基金经理	2014年11月13日	-	6	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2009年7月加入国投瑞银,从事固定收益研究工作。现任国投瑞银货币市场基金、国投瑞银瑞易货币市场基金、国投瑞银钱多宝货币市场基金、国投瑞银增利宝货币市场基金和国投瑞银双债增利债券型基金基金经理。
颜文浩	本基金基金经理	2014年12月04日	-	5	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2010年10月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞易货币基金、钱多宝货币基金、增利宝货币基金和添利宝货币基金基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银钱多宝货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末(2015年9月30日),本基金A级份额净值为1.100元,C级份额净值为1.099元,本报告期A级份额净值增长率为2.40%,C级份额净值增长率为2.22%,同期业绩比较基准收益率为1.86%,基金净值增长率高于业绩基准的主要原因是信用债的配置和选择上取得了相对收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为经济进入新常态,仍面临较大的结构调整和下行压力,货币政策放松仍有空间。我们认为汇率仍是货币政策和债市的影响因素之一,随着目前国内比较优势的逐步下降,经济转型任重道远,预计本币贬值压力仍然存在。目前收益率曲线平坦化明显,长期国债利率与2008年的低点已经较为接近,而货币市场利率仍维持在较高位置,因此我们认为四季度盘整概率较大,收益率曲线维持平坦化。

因此我们将维持适中的组合久期,保持适度杠杆,以获取票息收益为主。我们认为未来的1-2年均为信用风险释放期,我们将严控信用风险,精选信用债。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,847,232,366.87	95.22
	其中:债券	1,847,232,366.87	95.22
	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	52,053,290.23	2.68
8	其他资产	40,687,976.18	2.10
9	合计	1,939,973,633.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告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	128,827,025.60	9.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	235,351,335.40	17.07
	其中:政策性金融债	235,351,335.40	17.07
4	企业债券	518,309,606.87	37.59
5	企业短期融资券	731,828,900.00	53.08
6	中期票据	232,915,500.00	16.89
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,847,232,366.87	133.97

5.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	1,828,940	184,568,335.40	13.39
2	011537008	15中建材SCP008	1,300,000	130,000,000.00	9.43
3	011513003	15招商局SCP003	1,000,000	99,930,000.00	7.25
4	122757	11丹东债	850,390	88,185,443.00	6.40
5	020076	15贴债02	806,640	79,042,653.60	5.73

5.6 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.89
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	19,789,870.10 / 0.69
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限?	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

注:本基金基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	23.53	0.69
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	34.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	9.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	24.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.10	0.69

5.4 报告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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	175,326,428.96	6.13
	其中:政策性金融债	175,326,428.96	6.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	994,831,300.21	34.78
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,655,896.37	0.69
8	其他	-	-
9	合计	1,189,813,625.44	41.60
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011581005	15淮南矿SCP005	500,000	49,987,065.63	1.75
2	011599493	15南方水泥SCP006	500,000	49,985,842.30	1.75
3	011574006	15陕煤化SCP006	500,000	49,979,652.59	1.75
4	130236	13国开06	450,000	45,031,794.94	1.57
5	011574005	15陕煤化SCP005	450,000	44,987,206.62	1.57
6	011530003	15中海运SCP003	400,000	39,975,412.63	1.40
7	011599570	15鲁黄金SCP013	400,000	39,974,753.76	1.40
8	011599153	15山钢SCP004	300,000	29,999,898.04	1.05
9	011586006	15光明SCP006	300,000	29,997,335.02	1.05
10	011599320	15穗地铁SCP002	300,000	29,996,004.73	1.05

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2047%
报告期内偏离度的最低值	0.1328%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1681%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.8.2 本基金本报告期内无剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	18,860,908.58
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	18,860,908.58

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	国投增利宝货币A	国投增利宝货币B
报告期期初基金份额总额	26,664,424.10	2,049,846,619.96
报告期基金总申购份额	136,619,163.19	8,591,275,545.71
减:报告期基金总赎回份额	57,129,390.02	7,887,086,125.36
报告期期末基金份额总额	106,154,197.27	2,754,036,040.31

注:总申购份额含红利再投、转入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年07月03日	20,000,000.00	20,000,000.00	0
2	红利再投资	2015年09月30日	155,022.88	155,022.88	-
合计			20,155,022.88	20,155,022.88	

注:1、本报告期内本基金管理人交易及持有份额均为国投增利宝货币A类份额。

2、上述管理人红利再投资交易数据为报告期间内每个工作日红利再投资份额及金额合计数字。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内基金管理人对公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜进行公告,指定媒体公告时间为2015年7月6日。

2.报告期内基金管理人对本基金暂停/恢复申购(转换转入、大额定期定额投资)进行公告,指定媒体公告时间为2015年8月31日。

3.报告期内基金管理人对本基金调整大额申购(转换转入、定