

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:2015年10月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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。本公司承诺不从事内幕交易、操纵市场及其他不正当行为。

基金管理人承诺就基金投资运作情况及时向基金托管人报告,接受基金托管人监督。

基金托管人承诺在履行职责时严格遵守法律法规,尽心尽责地履行受托义务。

本基金无费用豁免情形。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金基本情况

基金名称 国投瑞银成长优选手混合型基金

基金代码 121008 前瞻:129008

交易代码 121008 后瞻:129008

基金合同生效日 2008年1月10日

报告期末基金份额总额 671,241,792.23份

投资目标 追求资产长期成长及收益有较好前景的企业,力求实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金将采取积极的投资型股票配置策略,借由Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)投资经验,在防守性的主动类别的配置基础上,自下而上地精选具有核心竞争力的行业,通过行业轮动和个股精选,在较长的期限内增长,同时,通过严谨的风险控制和管理措施,实现风险-收益的动态配比。

1. 类别资产配置:本基金在“上下的股票精选”为主,并通过适度调整类别资产配置比例,减小基金的系统性风险。

本基金根据资产类别中的市场状况和预期收益风险比例,对股票、债券、现金等资产类别进行配置,以达到风险与收益的平衡度。此外,本基金将利用基金管理人在长线投资管理方面的丰富经验,根据市场变化,适时地调整资产的配置,把握市场时机,在市场有效效应等所形成的机会时,增加股票投资的比重。

2. 投资管理:本基金的股票投资策略

以上而来的公司基本面分析为主,挑选优质成长企业,并运用GIPS评价体系对股票进行综合评价。

3. 投资管理:

本基金管理人通过IBS Global AM(瑞士银行环球资产管理公司)的固定收益组合,实现对债券的配置。

4. 风险收益特征:

本基金的股票投资与其对应的股票的收益率的差值(即Value Price)以及该证券对股价的敏感度,决定投资组合的评价质量,决策买入、卖出或持有。

业绩比较基准 80%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率

风险收益特征 本基金为混合型基金,股票投资比例95%,属于偏风险投资级别的基金。

基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司

注:根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)及《公开募集证券投资基金销售机构公平交易制度指导意见》,基金管理人于2015年6月16日将旗下基金持有的“国投瑞银成长优选手混合型证券投资基金”纳入长期投资组合类长期投资品种,其对基金简称更名为“国投瑞银成长优选手混合型基金”。上述变更对基金的持有人利益无不利影响。

§ 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(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -42,638,640.22

2.期初利润 -194,963,900.87

3.报告期内平均基金份额本期利润 0.0249

4.期末基金份额净值 621,067,696.23

5.期末基金份额总额 671,241,792.23份

6.报告期净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净增长额 (%) 净增长率 (%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -22.65% 3.38% -22.71% 2.64% 0.20% 0.74%

注:1.本基金的股票投资,根据所投资的股票的流通限制和买卖安排,在估值核算中考虑了流动性影响,因此可能与同类股票的估值存在差异,从而影响基金的净值表现。

2.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×中债国债指数收益+20%×中债信富基指数收益,变更为“80%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率”的比较。

3.2.2 本基金的股票投资采用与沪深300指数相同的权重比例。

4.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×中债国债指数收益+20%×中债信富基指数收益的比较。

5.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

6.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

7.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

8.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

9.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

10.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

11.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

12.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

13.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

14.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

15.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

16.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

17.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

18.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

19.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

20.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

21.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

22.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

23.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

24.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

25.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

26.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

27.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

28.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

29.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

30.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

31.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

32.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

33.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

34.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

35.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

36.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

37.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

38.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

39.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

40.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

41.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

42.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

43.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

44.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

45.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

46.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

47.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

48.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

49.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

50.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

51.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

52.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

53.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

54.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

55.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

56.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

57.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

58.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

59.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

60.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

61.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

62.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

63.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

64.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

65.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

66.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

67.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

68.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

69.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

70.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

71.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

72.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

73.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

74.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

75.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

76.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。

77.本基金的股票投资,其对基金的贡献率为70%×沪深300指数收益+20%×中债国债指数收益率的比较。