

(上接B041版)

法定代表人:刘军
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王彦
客服电话:95631;400-888-8588
公司网站:www.loupan.com.cn
(50)上海证券有限责任公司
住所:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德柏
电话:021-53519888
传真:021-53519888
联系人:张勇
客服电话:021-962518,4008-918-918
公司网站:www.962518.com
(51)国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国都投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国都投资大厦9层10层
法定代表人:常浩
电话:010-84183333
传真:010-84183311
联系人:吴静
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com
(52)国金证券股份有限公司
住所:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86660070
传真:028-86660126
联系人:刘一宏
客服电话:4006-600109;95105111(四川省内拨打)
公司网站:www.gjqz.com.cn
(53)万联证券股份有限公司
住所:广州市天河区珠江东路11号高第置地广场6楼18,19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高第置地广场6楼18,19层
法定代表人:张建军
电话:020-23896551
传真:020-22373718-1013
联系人:王鑫
客服电话:400-8888-133
公司网站:www.wljz.com.cn
(54)江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙洪涛
电话:0451-58563696
传真:0451-82287211
联系人:张雪北
客服电话:400-666-2288
公司网站:www.jhazq.com.cn
(55)华安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心26层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心26层
法定代表人:陈林
电话:021-68777222
传真:021-68777222
联系人:刘同川
客服电话:400-520-9898
公司网站:www.chuanbaobao.com.cn
(56)财信证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人:孙勇
电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:李莎
客服电话:0731-84403350
(57)方正证券股份有限公司
住所:湖南长沙芙蓉中路二段华信国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华信国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
电话:0731-88323503
传真:0731-88322314
联系人:董洪波
客服电话:95671
公司网站:www.fundazaser.com
(58)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
电话:010-63081000
传真:010-63080978
联系人:崔静
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
(59)宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:新疆乌鲁木齐市太平桥大街19号
法定代表人:冯锐
电话:010-86086588
传真:010-88085195
联系人:李巍
客服电话:400-800-562
公司网站:www.hysec.com
(60)国联证券股份有限公司
住所:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人:姚志勇
电话:0510-82321662
传真:0510-82321662
联系人:沈刚
客服电话:95670
公司网站:www.glsc.com.cn
(61)中国国际金融有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人:金捷
电话:010-65051166
传真:010-65059065
联系人:刘春香、肖冉
公司网站:www.cicc.com.cn
(62)华融证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路5033号新地大厦7、8层
办公地址:深圳市福田区益田路5033号新地大厦7-10层
法定代表人:黄金雄
电话:0591-87383000
传真:0591-87383010
联系人:张荣庆
客服电话:96326(福建省外加拨0691)
公司网站:www.hfzq.com.cn
(63)中信证券股份有限公司
住所:南昌市长子路中红谷中大道1619号国际金融中心41层
办公地址:南昌市长子路中红谷中大道1619号国际金融中心41层
法定代表人:杜航
电话:0791-86768681
传真:0791-86770178
联系人:戴静
客服电话:400-9966-567
公司网站:www.avicsec.com
(64)华龙证券股份有限公司
住所:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
法定代表人:李强安
电话:0931-4890208
传真:0931-4890628
联系人:李国田
客服电话:400-688-9888,0931-96668
公司网站:www.hlzqgs.com
(65)中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王明
电话:0756-4368888
传真:010-59495560
联系人:陈忠
客服电话:95648
公司网站:www.cscitic.com
(66)华泰证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3、5层
法定代表人:宋晓涛
电话:010-58852625
传真:010-58858284
联系人:黄恒
客服电话:010-58568118
公司网站:www.htsec.com.cn
(67)世纪证券有限责任公司
住所:深圳前海大道7088号招商银行大厦40/42层
办公地址:深圳前海大道7088号招商银行大厦40/42层
法定代表人:卢长戈
电话:0755-83195611
传真:0755-83195645
联系人:李璇
客服电话:0755-83195611
公司网站:www.csco.com.cn
(68)中原证券股份有限公司
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:曹国军
电话:0371-65565675
传真:0371-65565665
联系人:程月艳
客服电话:967218;400-813-9666
公司网站:www.ccnew.com.cn
(69)厦门证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅晓斌
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
联系人:赵欣
客服电话:0592-5163698
公司网站:www.xmzq.cn
(70)爱建证券有限责任公司
住所:上海市浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址:上海市浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人:宫龙云
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:魏莉
客服电话:021-63340678
公司网站:www.aijz.com.cn
(71)东北证券股份有限公司
住所:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:杨树财
电话:0431-59605617
传真:0431-59609675
联系人:安岩岩
客服电话:400-600-0686

公司网站:www.nesec.cn
(72)日信证券有限责任公司
住所:呼和浩特市新城区凯利南路18号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安大厦11层
法定代表人:孔庆松
电话:010-85991716
传真:010-89086637
联系人:陈文彬
客服电话:400-660-9839
公司网站:www.rlxq.com.cn
(73)民生证券股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人:余政
电话:010-85127999
传真:010-85127917
联系人:赵明
客户服务电话:400-619-8888
网站:www.msizq.com
(74)东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区星阳街5号
办公地址:苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
法定代表人:范力
电话:0512-65681136
传真:0512-65688021
联系人:方晓丹
客户服务电话:4008-601-565
网站:www.dwzq.com.cn
(75)瑞信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路4047号瑞信证券大厦13号
办公地址:深圳市福田区竹子林路光大银行大厦3楼
法定代表人:张辉伟
电话:0755-82047857
传真:0755-82835785
联系人:陈淑华
客户服务电话:95663
网站:www.ruixin.com.cn
(76)联讯证券股份有限公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
电话:0752-2119391
传真:0752-2119396
联系人:李勇
客户服务电话:400-9898-929
(77)华泰证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪荣泰
电话:021-64339000
传真:021-64333051
联系人:陈敏
客服电话:021-32109899;029-68918989
公司网站:www.htsec.com.cn
(78)浙商证券股份有限公司
住所:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
法定代表人:吴承根
电话:021-64310572
传真:021-64713795
联系人:陆云
客服电话:0571-96777
公司网站:www.stocke.com.cn
(79)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融大街9号富凯大厦701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座6505
法定代表人:林义相
电话:010-66494608
网站:010-66494521
联系人:尹伶
客服电话:010-66045678
天相投顾网站:http://www.txsec.com
天相基金网站:http://www.fund.txsec.com
(80)深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市福田区梅林街道6号众诚发展大厦10楼J单元
办公地址:深圳市福田区梅林街道6号众诚发展大厦10楼J单元
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227960
传真:0755-82800798
联系人:童彩平
客户服务电话:400-788-887
网站:www.zlfund.cn;www.jjmmw.com
(81)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号四楼449室
办公地址:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
法定代表人:张俊伟
电话:021-20613999
电话:021-20619999
联系人:张磊
客户服务电话:400-700-9665
网站:www.ehowbuy.com
(82)上海长基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
法定代表人:张俊伟
电话:021-20691835
电话:021-20691861
联系人:毕明峰
客户服务电话:400-099-1299
网站:www.eichfund.com
(83)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
住所:上海市金林区下陆镇曹路760号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城大厦689号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38602377
电话:021-38603777
联系人:万晨
客户服务电话:400-821-5399
网站:www.noah-fund.com
(84)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:021-60897809;0571-28829790
传真:0571-26886833
联系人:张裕
客服电话:4000-766-123
公司网站:market.fund123.cn
(85)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号302楼
法定代表人:其实
联系人:潘世华
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
公司网站:www.1234567.com.cn
(86)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区安立路360号励展国际大厦15层
办公地址:北京市朝阳区德胜门内大街2号民生大厦6层
法定代表人:闫捷
电话:010-62000808
电话:010-62003355
联系人:焦琳
客服电话:400-888-6661
公司网站:www.myfund.com
(87)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路9号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路2号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌峰平
电话:0571-88904118-8653
传真:0571-88904243
联系人:胡晓晨
电话:010-40877239
联系人:王楠
电话:021-20363585
联系人:王楠
电话:400-920-0022
公司网站:itikee.hxw.com.cn
(88)信和信信息科技股份有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:021-20363779
电话:021-20363885
联系人:王楠
电话:400-920-0022
公司网站:itikee.hxw.com.cn
(89)信普泽投资顾问(上海)有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809室
法定代表人:沈伟博
电话:010-52865713
传真:010-59494295
联系人:张朋
客服电话:400-6099-200
公司网站:www.yixinfund.com
(90)上海智慧财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人:李雄
电话:021-20219808
传真:021-20219923
联系人:付江
客服电话:021-20219931
公司网站:www.wq.com.cn
3.基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金。
名称:国投瑞银基金销售有限公司
住所:上海市虹口区东大名路638号9层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号卓越世纪中心46层
法定代表人:钱霖
联系人:冯伟
电话:0755/83575836
传真:0755/82912634
联系人:陈建伟
地址:深圳市福田区的律师事务所
名称:上海瑞泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、刘佳
地址:上海
(四)会计师事务所和独立注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴266号华夏银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦11楼
法定代表人:杨卫明
电话:021/23238888
传真:021/23238800
经办注册会计师:薛莹、叶尔哈
联系人:刘刚
四.基金名称
本基金名称:国投瑞银瑞银保本混合型证券投资基金
五.基金的类型

本基金类型:保本混合型。基金运作方式:契约型开放式
六.基金的投资目标
本基金追求在有效控制风险的基础上,运用投资组合保险技术,为投资人提供保本周期到期时保本金额安全增值,并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
七.基金的投资方向
本基金的投资范围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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票、权证、股指期货、货币市场工具及法律、法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。
本基金的投资对象主要分为两类:保本资产和收益资产。保本资产主要包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、次级债、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种。收益资产主要包括股票、权证以及股指期货等权益类品种。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
八.基金的投资策略
(一)资产配置策略
本基金资产配置策略分为两个层次:一层为对收益资产和保本资产的配置,该层次以组合保险策略为依据,即收益资产可能的损失金额不超过安全垫;另一层为对收益资产、保本资产内部的结构配置。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。
在确保资产配置符合《基金合同》规定的前提下,基金管理人将按照CPPI(Constant Proportionation Portfolio Insurance)恒定比例组合保险策略和TPTT(Time Invariant Portfolio Protection)时间不变性投资组合保险策略的要求动态调整保本资产和收益资产的配置比例,力求将收益资产可能的损失金额不超过安全垫的基础上,实现基金资产最大程度的增值。如在基金存续期内市场出现新的金融衍生工具且在开放式基金合同约定的投资范围之内,本基金管理人可以相应调整上述投资策略。
1.CPPI投资策略
根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动,组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整保本资产与收益资产的配置比例,通过对保本资产的投资实现保本周期到期时保本金额安全,通过对收益资产的投资实现保本周期内的增值增值。本基金对保本资产和收益资产的资产配置策略具体可分为以下四步:
第一步:确定保本资产的最低配置比例。
根据保本期末投资组合最低目标价值(本基金的最低保本值为保本金额的100%)和合理的贴现率,设定当期应持有的保本资产的最低配置数量及比例,即投资组合的价值底线。
第二步:确定收益资产的最高配置比例。
根据组合安全垫和收益资产风险特性,决定安全垫的放大倍数——避险系数,然后根据安全垫和避险系数计算当期应持有的收益资产的最高配置比例,其余资产投资于保本资产。
第三步:确定收益资产的动态配置比例。
根据组合安全垫和收益资产风险特性,决定安全垫的放大倍数——避险系数,然后根据安全垫和避险系数计算当期应持有的收益资产的最高配置比例,其余资产投资于保本资产。
第四步:动态调整保本资产和收益资产的配置比例。
根据保本资产、市场估值情况,并结合市场实际运行态势动态调整和调整保本资产和收益资产的配置比例,进行投资组合管理,实现基金资产在保本基础上的增值。
举例说明CPPI策略:
假设期初投资10亿元于股票和债券,投资期限为三年,放大倍数选为3。债券三年预期收益率为10%。
根据股票资产投资金额计算公式:
$$M = \frac{P_0 - P_{min}}{(1 + r) - 1}$$

可计算出期初投资于股票资产的金额为:2.308亿元(保留至小数点后3位)。因此,投资于债券资产的金额为:10-2.308=7.692亿元。
资产一段期间后,在T1时刻,假设股票资产上涨10%,而债券资产在此期间内投资收益率下降5%,则投资于股票资产的投资收益率为:
$$R = (1 + r) \times (1 + 10\%) \times (1 - 5\%) = 1.0326元$$

则股票资产总金额为:2.308*(1+10%)+7.692*(1-5%)=2.919亿元。
根据股票资产计算公式,可计算出在T1时刻可投资于股票资产的金额为:2.919亿元。
故在T1时刻将2.919亿元投资于股票,将7.389亿元投资于债券,由于此时基金拥有的债券资产为7.769亿元(7.692*(1+1%)=7.769),故基金管理人卖出0.380亿元债券(7.769-7.389=0.380),同时买入0.380亿元股票。
(81)上好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号四楼449室
办公地址:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
法定代表人:张俊伟
电话:021-20613999
电话:021-20619999
联系人:张磊
客户服务电话:400-700-9665
网站:www.ehowbuy.com
(82)上海长基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区高翔路524号2幢220室
法定代表人:张俊伟
电话:021-20691835
电话:021-20691861
联系人:毕明峰
客户服务电话:400-099-1299
网站:www.eichfund.com
(83)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
住所:上海市金林区下陆镇曹路760号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城大厦689号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38602377
电话:021-38603777
联系人:万晨
客户服务电话:400-821-5399
网站:www.noah-fund.com
(84)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:021-60897809;0571-28829790
传真:0571-26886833
联系人:张裕
客服电话:4000-766-123
公司网站:market.fund123.cn
(85)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号302楼
法定代表人:其实
联系人:潘世华
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
公司网站:www.1234567.com.cn
(86)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区安立路360号励展国际大厦15层
办公地址:北京市朝阳区德胜门内大街2号民生大厦6层
法定代表人:闫捷
电话:010-62000808
电话:010-62003355
联系人:焦琳
客服电话:400-888-6661
公司网站:www.myfund.com
(87)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路9号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路2号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌峰平
电话:0571-88904118-8653
传真:0571-88904243
联系人:胡晓晨
电话:010-40877239
联系人:王楠
电话:021-20363585
联系人:王楠
电话:400-920-0022
公司网站:itikee.hxw.com.cn
(88)信和信信息科技股份有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:021-20363779
电话:021-20363885
联系人:王楠
电话:400-920-0022
公司网站:itikee.hxw.com.cn
(89)信普泽投资顾问(上海)有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809室
法定代表人:沈伟博
电话:010-52865713
传真:010-59494295
联系人:张朋
客服电话:400-6099-200
公司网站:www.yixinfund.com
(90)上海智慧财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人:李雄
电话:021-20219808
传真:021-20219923
联系人:付江
客服电话:021-20219931
公司网站:www.wq.com.cn
3.基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金。
名称:国投瑞银基金销售有限公司
住所:上海市虹口区东大名路638号9层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号卓越世纪中心46层
法定代表人:钱霖
联系人:冯伟
电话:0755/83575836
传真:0755/82912634
联系人:陈建伟
地址:深圳市福田区的律师事务所
名称:上海瑞泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、刘佳
地址:上海
(四)会计师事务所和独立注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴266号华夏银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦11楼
法定代表人:杨卫明
电话:021/23238888
传真:021/23238800
经办注册会计师:薛莹、叶尔哈
联系人:刘刚
四.基金名称
本基金名称:国投瑞银瑞银保本混合型证券投资基金
五.基金的类型

的合理性和进行债券类选择。基金管理人关注信用利差隐含的投资机会;一是享有高品质信用产品的信用利差溢价;二是信用利差波动带来的投资机会。
个券选择策略是相,通过自上而下的债券分析流程,剔除出价值被市场误估的债券,择机投资低估债券,抛出高估债券。个券分析建立在价格/内在价值分析基础上,并考虑信用风险、流动性等相关因素。
本基金业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)
本基金选择三年期银行定期存款收益率作为业绩比较基准的原因如下:
本基金是保本型基金,保本周期为三年,保本但不保证收益。以三年期银行定期存款收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征,合理衡量比较本基金保本保证的有效性。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的基准指数推出,或者在市场上出现更加适用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以相应调整业绩比较基准,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
十.基金的投资组合特征
本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
十一.基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
1.基金资产组合情况
金额单位:人民币元
序号 项目 金额 占基金总资产比例(%)
1 权益投资 80,845.85 0.03
其中:股票 80,845.85 0.03
2 基金投资 -- --
3 固定收益投资 243,101,828.70 97.17
其中:债券 243,101,828.70 97.17
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 1,000,000.00 0.40
其中:买断式回购的买入返售金融资产 -- --
7 银行存款和备付金合计 2,114,312.92 0.85
8 其他各项资产 3,893,628.85 1.56
9 合计 250,960,612.32 100.00
2.按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元
代码 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 -- --
C 制造业 80,845.85 0.05
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 -- --
E 建筑业 -- --
F 交通运输、仓储和邮政业 -- --
G 批发和零售业 -- --
H 住宿和餐饮业 -- --
I 信息技术、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 80,845.85 0.05
3.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 002415 海康威视 4,633 80,845.85 0.05
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 -- --
2 央行票据 -- --
3 金融债券 69,223,000.00 40.09
其中:政策性金融债 69,223,000.00 40.09
4 企业债券 51,196,578.70 29.65
5 企业短期融资券 90,313,000.00 52.30
6 中期票据 29,921,000.00 17.33
7 可转债 2,448,250.00 1.42
8 其他 -- --
9 合计 243,101,828.70 140.78
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 100236 10国债36 400,000 39,980,000.00 23.15
2 04153409 13沪交CP001 200,000 20,608,000.00 11.62
3 130422 13国债22 200,000 19,258,000.00 11.15
4 122551 12沪行01 171,090 16,766,820.00 9.71
5 122313 12国债13 130,000 12,987,000.00 7.52
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。
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。
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投资。
9.报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
(2)本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据股指期货的投资目的,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的品种。
本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。
基金管理人将建立股指期货交易决策授权机制,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报批重事会批准。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
11.投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名证券中,持有10只C01:人民币,6777元,占基金资产净值的71%。根据中国石化股份有限公司2013年11月26日公布,该公司位于青岛经济技术开发区的前哨油库发生破裂,导致油库泄漏事故并造成人员伤亡。根据该公司2014年1月13日公布,国务院已认定为特别重大责任事故,并同意对事故有关责任单位和责任人进行处理,根据国务院事故调查组的责任认定,本次事故造成直接经济损失人民币75,172万元,公司将承担其相应赔偿义务。相关资金主要来自公司在以前年度购买的安全生产保险基金和公司向商业保险公司投保的营业巨灾保险。
(2)本基金投资的股票中,无涉及股指期货交易和股指期货持仓情况。
(3)其他资产构成
除上述情况外,本基金投资的前十名证券持有主体本期均没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。
(4)本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。
(3)其他资产的构成
金额单位:人民币元
序号 名称 金额
1 存出保证金 15,826.78
2 应收证券清算款 477.78
3 应收股利 -- --
4 应收利息 3,875,147.91
5 应收申购款 2,176.38
6 其他各项资产 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 3,893,628.85
(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 113001 中行转债 2,448,250.00 1.42
(5)报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明
本基金本报告期末前十名股票不存在受争议的情况。
(6)本基金期末投资股指期货投资、未投资股指期货未平仓的期货,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法律法规或本基金合同的规定。
十二.基金业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
国投瑞银瑞银保本混合型证券投资基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益比较表(截至2014年3月31日)
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③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④
2011.12.20(基金合同生效日) 0.01% 0.03% 0.16% 0.01% -0.06% 0.02%
2012.01.01至2012.12.31 3.20% 0.12% 4.71% 0.01% -1.51% 0.11%
2013.01.01至2013.12.31 3.33% 0.11% 4.34% 0.01% -1.01% 0.10%
2014.01.01至2014.03.31 2.09% 0.08% 1.05% 0.01% 1.04% 0.07%
自基金合同生效至今 8.96% 0.11% 10.59% 0.01% -1.63% 0.10%
注:1.本基金是保本型基金,保本周期为三年,保本但不保证收益。以三年期银行定期存款收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征,合理衡量比较本基金保本保证的有效性。
2.本基金业绩比较基准使用每日再平衡的计算方法。
(一)与基金运作有关的费用
1.基金的管理费;
(二)基金托管人的管理费;
(三)基金销售服务费;
(四)基金销售服务费;
(五)基金销售服务费;
(六)基金销售服务费;
(七)基金销售服务费;
(八)基金销售服务费;
(九)基金销售服务费;
(十)基金销售服务费;
(十一)基金销售服务费;
(十二)基金销售服务费;
(十三)基金销售服务费;
(十四)基金销售服务费;
(十五)基金销售服务费;
(十六)基金销售服务费;
(十七)基金销售服务费;
(十八)基金销售服务费;
(十九)基金销售服务费;
(二十)基金销售服务费;
(二十一)基金销售服务费;
(二十二)基金销售服务费;
(二十三)基金销售服务费;
(二十四)基金销售服务费;
(二十五)基金销售服务费;
(二十六)基金销售服务费;
(二十七)基金销售服务费;
(二十八)基金销售服务费;
(二十九)基金销售服务费;
(三十)基金销售服务费;
(三十一)基金销售服务费;
(三十二)基金销售服务费;
(三十三)基金销售服务费;
(三十四)基金销售服务费;
(三十五)基金销售服务费;
(三十六)基金销售服务费;
(三十七)基金销售服务费;
(三十八)基金销售服务费;
(三十九)基金销售服务费;
(四十)基金销售服务费;
(四十一)基金销售服务费;
(四十二)基金销售服务费;
(四十三)基金销售服务费;
(四十四)基金销售服务费;
(四十五)基金销售服务费;
(四十六)基金销售服务费;
(四十七)基金销售服务费;
(四十八)基金销售服务费;
(四十九)基金销售服务费;
(五十)基金销售服务费;
(五十一)基金销售服务费;
(五十二)基金销售服务费;
(五十三)基金销售服务费;
(五十四)基金销售服务费;
(五十五)基金销售服务费;
(五十六)基金销售服务费;
(五十七)基金销售服务费;
(五十八)基金销售服务费;
(五十九)基金销售服务费;
(六十)基金销售服务费;
(六十一)基金销售服务费;
(六十二)基金销售服务费;
(六十三)基金销售服务费;
(六十四)基金销售服务费;
(六十五)基金销售服务费;
(六十六)基金销售服务费;
(六十七)基金销售服务费;
(六十八)基金销售服务费;
(六十九)基金销售服务费;
(七十)基金销售服务费;
(七十一)基金销售服务费;
(七十二)基金销售服务费;
(七十三)基金销售服务费;
(七十四)基金销售服务费;
(七十五)基金销售服务费;
(七十六)基金销售服务费;
(七十七)基金销售服务费;
(七十八)基金销售服务费;
(七十九)基金销售服务费;
(八十)基金销售服务费;
(八十一)基金销售服务费;
(八十二)基金销售服务费;
(八十三)基金销售服务费;
(八十四)基金销售服务费;
(八十五)基金销售服务费;
(八十六)基金销售服务费;
(八十七)基金销售服务费;
(八十八)基金销售服务费;
(八十九)基金销售服务费;
(九十)基金销售服务费;
(九十一)基金销售服务费;
(九十二)基金销售服务费;
(九十三)基金销售服务费;
(九十四)基金销售服务费;
(九十五)基金销售服务费;
(九十六)基金销售服务费;
(九十七)基金销售服务费;
(九十八)基金销售服务费;
(九十九)基金销售服务费;
(一百)基金销售服务费;
(一百零一)基金销售服务费;
(一百零二)基金销售服务费;
(一百零三)基金销售服务费;
(一百零四)基金销售服务费;
(一百零五)基金销售服务费;
(一百零六)基金销售服务费;
(一百零七)基金销售服务费;
(一百零八)基金销售服务费;
(一百零九)基金销售服务费;
(一百一十)基金销售服务费;
(一百一十一