

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：2014年10月27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。  
基金托管人国投瑞银基金管理有限公司对定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配等信息复核无误，但不对报告内容的真实性、准确性、完整性、及时性等承担责任。  
基金销售人员承诺以诚实信用、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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银纯债债券
交易代码	121013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月1日
报告期末基金份额总额	374,988,477.99份
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，为投资者提供低波动、稳健回报的理财工具。
投资策略	本基金采取自上而下的投资策略，在确定大类资产配置比例的基础上，通过对宏观经济、利率、信用、行业等因素的深入分析，精选具有投资价值的券种，从而构建投资组合。具体采用何种策略取决于债券组合和风险的贡献率，择时调整策略。在不同的时期，将采用不同策略组合收益和风险的贡献率，择时调整策略。在不同的时期，将采用不同策略组合收益和风险的贡献率，择时调整策略。
业绩比较基准	中债综合指数收盘收益率
风险收益特征	本基金为纯债债券型基金，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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国投瑞银纯债债券A 国投瑞银纯债债券B
下属分级基金的交易代码	121013 128001
报告期末下属两级基金的份额总额	37,212,474.49份 337,776,003.44份

§ 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(2014年07月01日-2014年09月30日)						
国投瑞银纯债债券	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	456,068.10	6,390,417.28				
2.本期利润	613,972.70	7,958,112.30				
3.加权平均基金份额本期利润	0.0217	0.0211				
4.期末基金份额净值	38,674,854.42	352,192,274.56				
5.期末基金份额净值	1.039	1.043				

注：本期收入为应收利息收入、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，本期利润为本期实现的收入减去本期的公允价值变动收益等费用后的余额。

2.以上所列基金业指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.2 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.25% 0.60% 0.70% 0.07% 1.55% -0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.3 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.4 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.5 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.6 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.7 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.8 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.9 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.10 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.11 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.12 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.13 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.14 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.15 本报告期基金份额净值增长率为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 现价增长 业绩比较基准 球比基准差 球比基准差

率① 率② 基准收益 率③ 率④

过去三个月 2.06% 0.98% 0.70% 0.07% 1.36% 0.01%

注：1.本基金为纯债债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与同期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  
2.本基金选择中债综合指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.16 本报告期基金份额净值增长率为与同期业绩比较基准收益率的比较