

信息披露 Disclosure

国投瑞银策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2014年10月27日
5.1 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。
基金托管人根据本基金合同规定，于2014年10月24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內容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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。投资人对基金的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2014年7月1日起至9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银策略精选混合
基金代码	000005
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
基金合同生效日	2013年09月27日
报告期末基金份额总额	499,649,066.54份
投资目标	本基金通过对不同资产类别进行有机结合，有效控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下，注重风险与收益的平衡，精选具有较高投资价值的股票和债券，为投资者实现资产的长期稳定增长。 （一）类别的资产配置 本基金根据宏观经济形势判断预期收益的相对水平，对股票、债券等市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期达到风险和收益的平衡。 （二）投资品种选择 本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。 本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。 本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。 本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。
投资策略	本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。 本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。 本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高收益。本基金的预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
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

5.3 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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	19,583,822.21
2.本期利润	47,346,322.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.1756
4.期末基金资产净值	585,036,772.83
5.期末基金份额净值	1.171

注：1.本期已实现收益指基金本期收入扣除应付费用后的余额，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.以上所列基金绩效指标均包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如申购赎回费、基金转换费等），计价单位实际利润未平等于所列数字。

3.2 基金净值表现

本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较				
阶段	净值增长 率①	净值增 长率差 率②	业绩比 较基准 收益率 率③	业绩比 较基准 收益率差 率④
过去三个月	15.14%	0.71%	7.43%	0.50%
			7.71%	0.21%

注：1.本基金管理人定期报告披露的基金净值增长率是按收益分配后重新计算的，因此与定期报告披露的净值增长率可能不一致。
2.6%为基准，根据股市、债市等分类资产的预期风险与预期收益的比较与分析进行调整。为此，你拟基金资产配置与市场指数代表等数据，本基金选择以沪深300指数为代表的股票资产总值占总资产作为本基金的基金业绩评价基准，具体为6%×沪深300指数+40%×中债国债指数+50%×中债企业债指数。

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份额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



注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6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相关说明书中有关投资比例的约定。

5.4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业 年限	说明
马少萍	本基金基 金经理	2013年9月27 日	16	中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任银行信贷员、东吴基金管理公司基金经理助理、国投瑞银基金管理有限公司基金经理。现任国投瑞银基金管理有限公司基金经理兼国投瑞银策略精选基金经理。
陈小玲	本基金基 金经理	2014年1月14 日	9	中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任职于招银基金管理有限公司，2005年8月加入国投瑞银基金管理有限公司，现任国投瑞银策略精选基金经理兼国投瑞银中国基金基金经理。

注：任前即担任基金经理期间即对公司作出决定性或对外公告之日，证券从业的含义从该从业人员从业证券业之日起算。

4.2 财务管理人对报告期内本基金运作情况的说明

报告期内，本基金管理人遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的各项规定，本基金管理人诚信、勤勉尽责，忠实履行职责，为基金份额持有人的利益管理运用基金财产。在报告期内，本基金的各项操作符合法律法规的规定。

4.3 投资决策情况

本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。

4.4 研究支持情况

本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。

4.5 交易监控情况

本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。

4.6 风险控制情况

本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。

4.7 其他情况

本基金在综合分析各行业基本面的基础上进行配置，也根据宏观经济环境以及各自行业的基本面特征对行业配置进行动态调整。

4.8 报告期内本基金没有发生单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金总份额的20%的情形。

4.9 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.10 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.11 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.12 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.13 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.14 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.15 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.16 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.17 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.18 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.19 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.20 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.21 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.22 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.23 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.24 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.25 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.26 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.27 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.28 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.29 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.30 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.31 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.32 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.33 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.34 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.35 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.36 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.37 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.38 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.39 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.40 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.41 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.42 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.43 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.44 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.45 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.46 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.47 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.48 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.49 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.50 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.51 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.52 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.53 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.54 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.55 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.56 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.57 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.58 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.59 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.60 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.61 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.62 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.63 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.64 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.65 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.66 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.67 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。

4.68 报告期内本基金没有发生单一投资人赎回金额超过基金净资产值10%的情形。

4.69 报告期内本基金没有发生单一投资人申购金额超过基金总资产20%的情形。</