

国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金

2015第一季度报告

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2015年4月20日

基金管理人的董事会及高级管理人员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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2015年4月16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。
基金投资涉及风险。投资者在作出投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金当前无申购赎回限制。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,625,533.08	1.18
C	制造业	404,518,945.36	49.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,615,124.00	1.05
F	批发和零售业	57,974,533.76	7.10
G	交通运输、仓储和邮政业	14,044,231.44	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,429,446.10	5.93
J	金融业	95,447,470.80	11.68
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	其他	-	-
	合计	638,655,012.54	78.16

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002990	信邦制药	3,493,776	106,839,670.08	13.08
2	000553	万里扬	296,931	48,429,446.10	5.93
3	000829	天音通信	2,142,460	39,313,640.00	4.81
4	000600	中航资本	1,096,800	35,800,056.00	4.38
5	600837	高通股份	1,529,100	35,796,231.00	4.38
6	000800	一汽轿车	1,509,051	29,577,399.60	3.62
7	002384	东方园林	1,999,856	28,757,929.28	3.52
8	300054	爱尔眼科	1,236,749	28,074,202.30	3.44
9	002236	大华股份	997,982	21,856,242.10	2.67
10	601877	正泰电器	463,300	19,046,263.00	2.33

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,015,000.00	4.90
4	企业债	40,015,000.00	4.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	40,015,000.00	4.90

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140218	14国债18	300,000	30,012,000.00	3.67
2	140429	14农发29	100,000	10,003,000.00	1.22
3	140429	14国债29	100,000	10,003,000.00	1.22
4	140429	14农发29	100,000	10,003,000.00	1.22
5	140429	14国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

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五名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002990	信邦制药	3,493,776	106,839,670.08	13.08
2	000553	万里扬	296,931	48,429,446.10	5.93
3	000829	天音通信	2,142,460	39,313,640.00	4.81
4	000600	中航资本	1,096,800	35,800,056.00	4.38
5	600837	高通股份	1,529,100	35,796,231.00	4.38

5.7 本期报告期末持有的处于转持待售的可转换债券明细

注：本基金自建仓期起至本基金合同生效之日起的5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。

5.8 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间 说明

张弘 本基金基金经理 2013年7月31日 -

注：任期间即担任期间内因公司原因决定卸任后不再对外公告之日。证券从业的年限从通过证券从业人员资格考试之日起计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性的说明

报告期内，基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其他法律法规的规定，严格按照基金合同的约定，履行了基金管理人应尽的义务，勤勉尽责地履行了基金管理人的职责，没有损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易相关的制度，通过工作制度、流程和计算机系统等手段对不同投资组合间的交易行为进行监控，形成了有效的公平交易体系。本报告期，本基金管理人未发现不公平交易的情况。

4.4 投资组合报告

4.5 报告期内基金业绩表现

本基金报告期内实现收益总额为1,490,490.00元，实现收益总金额为1,490,490.00元，其中利息收入为1,490,490.00元，手续费收入为0.00元，投资收益为0.00元，公允价值变动损益为0.00元。

4.6 投资组合变动情况

本基金报告期内不存在超过百分之二点五的基金资产净值变动比例的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望一季度，我们认为创业板个股在大幅上涨后可能会阶段性回调，而大盘蓝筹股则可能会有阶段性表现，但从中长期看，本基金的资产并不低于沪深300指数。

4.8 管理人对行业配置的调整及原因

本基金在报告期内未进行行业配置的调整。

4.9 报告期内基金绩效评价

本基金在报告期内未出现超过百分之二点五的基金资产净值变动比例的情形。

4.10 报告期内基金组合投资情况

本基金在报告期内不存在组合投资的情况。

4.11 报告期内基金的税收情况

本基金在报告期内未发生与基金相关的税收。

4.12 报告期内基金费用计提及支付情况

本基金在报告期内未发生与基金相关的费用。

4.13 报告期内其他重要事项

本基金在报告期内未发生其他重要事项。

4.14 备查文件目录

关于核准国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复（证监许可[2008]449号）

关于核准国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金募集的公告（基金合同[2008]242号）

《国投瑞银稳健增长灵活配置型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银稳健增长灵活配置型证券投资基金托管协议》

《国投瑞银基金管理有限公司企业信用报告》

《国投瑞银基金管理有限公司企业年检报告书》

《国投瑞银基金管理有限公司企业法人营业执照》

《国投瑞银基金管理有限公司组织机构代码证》

《国投瑞银基金管理有限公司税务登记证》

《国投瑞银基金管理有限公司银行开户许可证》

《国投瑞银基金管理有限公司基金销售业务资格证书》

《国投瑞银基金管理有限公司基金销售机构基金销售业务资格证书》

《国投瑞银基金管理有限公司基金销售支付结算机构基金销售支付结算业务资格证书》

《国投瑞银基金管理有限公司基金销售支付结算机构