

国投瑞银岁丰利一年期定期开放债券型证券投资基金

[2015] 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:2015年10月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及基金经理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，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千元的情形。

4.7 对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为经济进入新常态，仍面临较大的结构调整和下行压力，货币政策放松仍有空间。我们认为汇率仍是政策和市场的影响力之一，随着目前国内比较优势的逐步下降，经济转弱至重压，预计本币贬值压力仍然存在。目前收益率曲线平坦化明显，长期国债利率与2008年的低点已经较接近，而货币市场利率仍保持在较高位置，因此我们认为三季度盈差概率较大，收益率曲线维持平坦化。

因此我们将维持持仓的中长期票，保持适度杠杆，以获取票息收益为主。我们认为未来的1-2年均为信用风险释放期，我们将严控信用风险，精选信用债。

4.8 影响投资者决策的重要因素

投资目标：投资于固定收益类金融工具，实现资金的保值增值。

本基金报告期自2015年7月21日起(基金合同期)起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

率为0.05%，C级份额净值增长率为0.05%，同期基金业绩比较基准收益率为0.05%。基金净值增长率低于业绩基准的主要原因是新基金成立初期的影响。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千元的情形。

4.7 对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为经济进入新常态，仍面临较大的结构调整和下行压力，货币政策放松仍有空间。我们认为汇率仍是政策和市场的影响力之一，随着目前国内比较优势的逐步下降，经济转弱至重压，预计本币贬值压力仍然存在。目前收益率曲线平坦化明显，长期国债利率与2008年的低点已经较接近，而货币市场利率仍保持在较高位置，因此我们认为三季度盈差概率较大，收益率曲线维持平坦化。

因此我们将维持持仓的中长期票，保持适度杠杆，以获取票息收益为主。我们认为未来的1-2年均为信用风险释放期，我们将严控信用风险，精选信用债。

4.8 影响投资者决策的重要因素

投资目标：投资于固定收益类金融工具，实现资金的保值增值。

本基金报告期自2015年7月21日起(基金合同期)起至2015年9月30日止。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	股权投资	-	-
2	股票	-	-
3	固收类投资	729,692,014.74	97.79
4	债券	729,692,014.74	97.79
5	货币市场基金	-	-
6	银行存款	-	-
7	定期存款和结算备付金合计	6,846,044.06	0.09
8	其他资产	9,673,474.62	1.30
9	合计	746,211,533.62	100.00

本基金报告期末未持有股票投资。

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币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 国投瑞银岁丰利一年债券A 国投瑞银岁丰利一年债券C

基金代码 001137 001138

报告期末下属分级基金的份额总额 623,571,712.03份 60,739,046.76份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

基金简称 国投瑞银岁丰利一年债券C 报告期(2015年07月21日-2015年09月30日)

国投瑞银岁丰利一年债券A 国投瑞银岁丰利一年债券C

1.本期已实现收益 2,654,507.33 260,730.03

2.本期利润 2,700,768.00 277,606.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.0062 0.0046

4.期末基金资产净值 626,072,490.43 61,016,494.27

5.期末基金份额净值 1.006 1.006

注:1.本期实现收益指基金本期利润扣除非收入、兑现收益，其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期利润扣除非收入、兑现收益后加上本期公允价值变动收益。

2.本期可供分配利润指基金本期利润减去本期利润已实现部分后的余额(即基金申购赎回款、基金转换费等)，计入期末可供分配利润。

3.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

4.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

5.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

6.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

7.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

8.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

9.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

10.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

11.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

12.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

13.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

14.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

15.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

16.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

17.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

18.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

19.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

20.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

21.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

22.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

23.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

24.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

25.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

26.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

27.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

28.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

29.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

30.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

31.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

32.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

33.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

34.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

35.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

36.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

37.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

38.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

39.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

40.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

41.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

42.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

43.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

44.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

45.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

46.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

47.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

48.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

49.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

50.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

51.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

52.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

53.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

54.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

55.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

56.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

57.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

58.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

59.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

60.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

61.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

62.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

63.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

64.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

65.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

66.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

67.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

68.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%

69.当年期间平均收益率=当年期间内每日报价收益之和/当年期间内每日报价收益之和×100%