

## 国投瑞银瑞盈灵活配置混合型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

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:2016年1月20日

注:本基金报告期内未持有通过沪深交易所机制投资的股票。

5.1 重要提示

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。  
基金托管人根据法律法规的规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等数据，保证复核结果与基金管理人提供的数据一致。  
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。

本基金报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)止。

5.2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银瑞盈混合

场内简称 瑞盈混合

基金主代码 161207

基金运作方式 混合型基金

基金合同生效日 2010年6月10日

报告期末基金份额总额 1,209,196,623.00份

投资目标 在有效控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，力争基金资产的持续稳健增长。

本基金的投资策略包括资产配置策略、股票精选策略、折价与溢价策略、债券配置策略。

(一) 股票配置策略

本基金根据各资产类别的市场趋势和相对收益风险的比较判断，对股票、债券和货币市场工具的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险收益的最优平衡。

在进行股票配置时，将采用自下而上逐层分析的方法确定行业配置策略。

行业配置：在投资组合构建过程中，根据股票的行业属性及其行业特征及行业景气度，在行业配置上进行动态调整。

个股选择：在行业配置的基础上，通过深入研究公司的基本面情况，分析公司的价值创造能力、成长性评价、现金流状况和经营评估等，

分析公司所处行业的估值水平，从而选择具有投资价值的股票。

(二) 债券配置策略

本基金采用自上而下的债券分析方法，确定债券投资组合，并根据组合的风险配置。

组合风险管理

本基金在注重风险管理的前提下，以长期保值为

目的，适度运用信用策略。

2. 固定期限投资策略

本基金根据固定期限品种的预期风险，本基金的固定期限品种的预期风险，以长期持有的方式，运用信用策略，分析固定期限品种的预期风险和预期收益，择优选择固定期限品种。

3. 衍生品投资策略

本基金根据衍生品的预期风险，选择适当的衍生品进行投资。

4. 风险收益特征

本基金的风险收益特征介于股票型基金和货币市场基金之间，属于股票型基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 1,370,466.79

2.期初现金及现金等价物余额 194,928,232.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.1415

4.期末基金资产净值 1,205,694,362.08

5.期末基金份额 3,019

6.期末可供分配基金份额利润 0.019

7.期末可供分配金额 1,205,694,362.08

8.期末基金资产总值 1,205,694,362.08

9.期末可供分配基金份额净值 0.4019

10.期末基金份额净值 0.4019

11.期末可供分配金额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

12.期末可供分配基金份额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

13.期末资产负债率(%) 0.01%

14.期末持有现金及存出保证金占基金资产净值的比例(%) 9.14%

15.期末期初基金份额净值 0.393

16.期末基金净值增长率 0.94%

17.期末基金净值增长率标准差 0.83%

18.期末基金净值增长率偏离度 0.14%

19.期末基金净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

20.期末基金资产配置情况

21.期末股票投资 50,046,409

22.期末债券投资 5,333,333

23.期末贵金属投资 6,738,768

24.期末基金保留的买入期权合约公允价值 5,676,856

25.期末基金保留的卖出期权合约公允价值 73,117,892.40

26.期末定期存款 8,000,000

27.期末应收申购款 4,153,354

28.期末应付赎回款 7,118,501

29.期末其他资产 3,286,896

30.期末负债合计 66,496,197.54

31.期末净资产 1,205,694,362.08

32.期末基金份额净值 0.4019

33.期末可供分配基金份额净值增长率 0.94%

34.期末可供分配基金份额净值增长率标准差 0.83%

35.期末可供分配基金份额净值增长率偏离度 0.14%

36.期末可供分配基金份额净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

37.期末基金资产总值 1,205,694,362.08

38.期末基金份额 3,019

39.期末可供分配金额 1,205,694,362.08

40.期末可供分配金额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

41.期末可供分配基金份额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

42.期末资产负债率(%) 0.01%

43.期末持有现金及存出保证金占基金资产净值的比例(%) 9.14%

44.期末期初基金份额净值 0.393

45.期末基金净值增长率 0.94%

46.期末基金净值增长率标准差 0.83%

47.期末基金净值增长率偏离度 0.14%

48.期末基金净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

49.期末基金资产配置

50.期末股票投资 50,046,409

51.期末债券投资 5,333,333

52.期末贵金属投资 6,738,768

53.期末定期存款 8,000,000

54.期末应收申购款 4,153,354

55.期末应付赎回款 7,118,501

56.期末其他资产 3,286,896

57.期末负债合计 66,496,197.54

58.期末净资产 1,205,694,362.08

59.期末基金份额净值 0.4019

60.期末可供分配基金份额净值增长率 0.94%

61.期末可供分配基金份额净值增长率标准差 0.83%

62.期末可供分配基金份额净值增长率偏离度 0.14%

63.期末可供分配基金份额净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

64.期末基金资产总值 1,205,694,362.08

65.期末基金份额 3,019

66.期末可供分配金额 1,205,694,362.08

67.期末可供分配金额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

68.期末可供分配基金份额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

69.期末资产负债率(%) 0.01%

70.期末持有现金及存出保证金占基金资产净值的比例(%) 9.14%

71.期末期初基金份额净值 0.393

72.期末基金净值增长率 0.94%

73.期末基金净值增长率标准差 0.83%

74.期末基金净值增长率偏离度 0.14%

75.期末基金净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

76.期末基金资产配置

77.期末股票投资 50,046,409

78.期末债券投资 5,333,333

79.期末贵金属投资 6,738,768

80.期末定期存款 8,000,000

81.期末应收申购款 4,153,354

82.期末应付赎回款 7,118,501

83.期末其他资产 3,286,896

84.期末负债合计 66,496,197.54

85.期末净资产 1,205,694,362.08

86.期末基金份额净值 0.4019

87.期末可供分配基金份额净值增长率 0.94%

88.期末可供分配基金份额净值增长率标准差 0.83%

89.期末可供分配基金份额净值增长率偏离度 0.14%

90.期末可供分配基金份额净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

91.期末基金资产总值 1,205,694,362.08

92.期末基金份额 3,019

93.期末可供分配金额 1,205,694,362.08

94.期末可供分配金额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

95.期末可供分配基金份额占期末基金资产净值的比例(%) 0.02%

96.期末资产负债率(%) 0.01%

97.期末持有现金及存出保证金占基金资产净值的比例(%) 9.14%

98.期末期初基金份额净值 0.393

99.期末基金净值增长率 0.94%

100.期末基金净值增长率标准差 0.83%

101.期末基金净值增长率偏离度 0.14%

102.期末基金净值增长率偏离度的绝对值 0.14%

103.期末基金资产配置

104.期末股票投资 50,046,409

105.期末债券投资 5,333,333

106.期末贵金属投资 6,738,768

107.期末定期存款 8,000,000

108.期末应收申购款 4,153,354

109.期末应付赎回款 7,118,501

110.期末其他资产 3,286,896

111.期末负债合计 66,496,197.