

国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金

2015年度报告摘要

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
送出日期：2016年03月28日

1.1 重要提示
基金管理人承诺：基金管理人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。本年度报告除个别数据经会计师事务所审计外，其他数据均由基金管理人自行编制。基金托管人复核了本报告中的财务数据、净值表现、投资组合等内容，但基金管理人对其真实性、准确性和完整性不承担责任。基金管理人承诺：基金管理人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。本年度报告除个别数据经会计师事务所审计外，其他数据均由基金管理人自行编制。基金托管人复核了本报告中的财务数据、净值表现、投资组合等内容，但基金管理人对其真实性、准确性和完整性不承担责任。

2 基金基本情况

基金名称	国投瑞银境煊保本混合
基金代码	001017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年03月26日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,000,326,204.98
基金合同存续期	不定期

本基金为保本混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

2.1 基金业绩说明

项目	国投瑞银境煊保本混合	同期业绩比较基准
基金份额净值增长率	714.983,421.54%	3.285,322,421.54%
同期业绩比较基准	3.285,322,421.54%	3.285,322,421.54%

本基金在报告期内业绩表现良好，主要得益于资产配置得当，风险控制严格。

2.2 基金管理人、基金托管人

基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金管理人	张勇	基金托管人	张勇
基金管理人	010-688-8888	基金托管人	0755-83199004

2.3 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

2.4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

3 主要财务指标

本期基金份额净值增长率	714.983,421.54%
本期基金份额净值增长率标准差	0.000%
本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	0.000%

4 投资组合报告

报告期末基金资产组合情况如下：股票投资0.00%，债券投资0.00%，货币市场工具100.00%。

5 流动性风险分析

本基金为保本混合型证券投资基金，流动性风险较低，能够满足投资者的赎回需求。

6 其他重要事项

报告期内基金管理人未发生任何重大违法违规行为，基金运作规范。

7 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

8 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

9 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

10 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

11 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

12 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

13 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

14 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

15 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

16 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

17 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

18 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

19 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

20 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

21 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

22 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

23 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

24 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

25 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

26 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

27 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

28 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

29 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

30 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

31 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

32 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

33 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

34 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

35 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

36 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

37 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

38 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

39 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

40 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

41 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

42 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

43 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

44 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

45 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

46 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

47 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

48 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

49 基金投资策略

本基金采用资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

50 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：两年定期存款利率+1.5%。

51 基金管理人、基金托管人

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601888	华泰证券	748,100	14,720,520.00	0.37
2	600208	中国石化	2,968,500	14,720,760.00	0.36
3	000827	鲁商置业	482,182	14,094,536.22	0.35
4	600422	良辰药业	229,100	9,122,762.00	0.23
5	600561	际华集团	662,469	9,098,000.00	0.23
6	600688	华夏银行	214,000	8,946,320.00	0.23
7	002079	汇源医药	495,000	8,529,270.00	0.21
8	002191	珈伟股份	548,200	8,420,262.00	0.21
9	002090	加加食品	1,027,600	8,344,112.00	0.21
10	000513	珠江啤酒	130,897	7,617,414.71	0.19

注：投资者想了解本报告期内基金资产的详细情况，应查阅国投瑞银境煊保本混合型证券投资基金定期报告（http://www.fund.10000.com.cn/）。

8.4 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或20%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002010	天鸿集团	16,229,796.76	0.40
2	600688	华夏银行	11,035,020.22	0.40
4	000827	鲁商置业	12,007,324.54	0.30
5	002191	珈伟股份	10,009,262.00	0.25
6	002090	加加食品	9,040,926.00	0.23
7	000568	飞鹿乳业	8,038,842.00	0.20
8	000598	九江股份	8,034,626.94	0.20
10	002090	加加食品	8,034,162.40	0.20
11	600422	良辰药业	8,027,313.16	0.20
12	000228	潍柴动力	8,018,894.46	0.20
13	000043	一汽轿车	8,014,443.00	0.20
14	000000	一汽汽车	8,014,143.00	0.20
15	000027	华能国际	8,012,988.02	0.20
16	000778	运盛实业	8,012,788.00	0.20
17	000089	渤海租赁	8,011,163.00	0.20
18	000228	潍柴动力	8,008,842.00	0.20
19	600118	中国卫星	8,004,101.17	0.20
20	002226	华信股份	8,003,728.00	0.20

8.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或20%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002010	天鸿集团	17,422,862.29	0.43
2	300103	达瑞电子	8,909,196.03	0.22
3	600688	华夏银行	8,778,472.18	0.22
4	600601	联华国际	8,771,643.00	0.22
5	000041	黄金白银	8,572,134.73	0.21
6	600296	顺兴股份	8,567,356.04	0.21
7	000020	方正通信	8,409,398.22	0.21
8	000276	华信股份	8,359,928.91	0.21
9	600705	工人软件	8,319,411.00	0.21
10	000028	潍柴动力	8,311,163.00	0.21
11	600098	九鼎投资	8,285,622.00	0.21
12	000046	宝信软件	8,256,672.00	0.21
13	000029	三花股份	8,250,746.27	0.21
14	000025	长电科技	8,229,272.08	0.21
15	600835	安洁科技	8,254,446.63	0.21
16	600078	中国路桥	8,213,790.00	0.20
17	600118	中国卫星	8,147,526.80	0.20
18	000089	渤海租赁	8,141,617.00	0.20
19	000066	宇通客车	8,047,392.66	0.20
20	000017	美都能源	8,033,080.00	0.20

8.4.3 买入股票的成本及支出超过期初资产总额

序号	股票代码	股票名称	金额
1	002010	天鸿集团	321,817,733.87
2	000017	美都能源	232,134,700.44

8.5 卖出股票成本及支出超过期初资产总额

序号	股票代码	股票名称	金额
1	000017	美都能源	223,973,741.50
2	600028	中国石化	31,497,143.00
3	600028	中国石化	31,497,143.00
4	600028	中国石化	28,492,629.00
5	600028	中国石化	28,492,629.00
6	600028	中国石化	28,492,629.00
7	600028	中国石化	28,492,629.00
8	600028	中国石化	28,492,629.00
9	600028	中国石化	28,492,629.00
10	600028	中国石化	28,492,629.00
11	600028	中国石化	28,492,629.00
12	600028	中国石化	28,492,629.00
13	600028	中国石化	28,492,629.00
14	600028	中国石化	28,492,629.00
15	600028	中国石化	28,492,629.00
16	600028	中国石化	28,492,629.00
17	600028	中国石化	28,492,629.00
18	600028	中国石化	28,492,629.00
19	600028	中国石化	28,492,629.00
20	600028	中国石化	28,492,629.00

8.6 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	占基金资产净值比例(%)
1	100000	国债	223,973,741.50	8.56	
2	100000	国债	31,497,143.00	0.79	
3	100000	国债	31,497,143.00	0.79	
4	100000	国债	28,492,629.00	0.71	
5	100000	国债	28,492,629.00	0.71	
6	100000	国债	28,492,629.00	0.71	
7	100000	国债	28,492,629.00	0.71	
8	100000	国债	28,492,629.00	0.71	
9	100000	国债	28,492,629.00	0	