

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

2017年年度报告摘要

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年一月二十七日
重要提示

1.1 基金管理人的董事会、监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。
1.2 基金托管人报告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。
1.3 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。
1.4 基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,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及其摘要、基金产品资料概要、定期报告及基金招募说明书。
1.5 本报告期无向基金份额持有人进行定期报告,投资人欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
1.6 本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 国投瑞银优化增强债券

基金代码 121012

交易代码 121012(前端) 121012(后端)

基金运作方式 灵活的开放式

基金合同生效日 2010年9月1日

基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

基金合同存续期间 不定期

下属分级基金的基金简称 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

下属分级基金的交易代码 121012 128112

报告期末下属分级基金的份额总额 637,968,547.05份 102,461,038.32份

2.2 基金产品说明

投资目标 在追求基金资产增值的前提下,有效控制风险和保持基金资产的流动性的基础上,通过积极主动的资产配置,力求获得高于业绩比较基准的稳定收益。

1. 资产配置 本基金采取稳健灵活的资产配置策略,通过配置固定收益类金融工具的主动管理,为投资者谋求稳定的收益,并根据对市场的趋势判断及新的投资机会,适时调整资产配置比例,在风险与收益之间寻求平衡和新的投资机会以二级市场的股票投资,力求超越基金的基准收益。

2. 业绩比较基准 95%×中债综合指数+5%×沪深300指数×10%

风险收益特征 本基金为债券基金,属于投资于债券市场的较低风险、风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金的股票型基金。

2.3 基金管理人和基金经理简介

项目 基金经理人 基金托管人

名称 国投瑞银基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

姓名 刘斌 田青

信息披露负责人 联系电话 400-890-6998 010-67956096

电子邮箱 service@utic.com twmp@icbc.com

客户服务电话 400-890-6998 010-67956096

传真 0755-32904048 010-62275983

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联 网网址 http://www.utic.com

基金年度报告备查地、地、址 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

2017年 2016年

3.1.1 利润分配和指标 2017年利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期已实现收益 60,707,- 34,248,- 30,133,- 8,029,- 121,016,- 65,994,-

本期分配金额 26055 06326 41126 81517 16916 56089

本期利润 43,283,- 33,600,- 21,798,- 16,-770,- 137,194,- 68,261,-

66033 456,566 62639 59438 12433 10818

加权平均基金份额净值 0.965 0.9028 0.9198 -0.0380 0.1948 0.1707

本期加权平均净值增长率 3.34% 4.59% 1.03% -2.48% 13.21% 12.03%

本期末基金份 额净值增 长率 3.64% 3.45% 1.10% 0.95% 16.96% 16.57%

3.1.2 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 846,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.3 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.4 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.5 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.6 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.7 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.8 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.9 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.10 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.11 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.12 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.13 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.14 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.15 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473

3.1.16 利润分配和指标 2017年末 2016年末 2015年末

利润分配和指标 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C 国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C

本期末基金份 额净值 946,795,- 134,396,- 2,189,859,- 1,603,150,-

978,153,- 737,737 060,771 829,48 787,72

利润分配和指标 0.2484 0.2413 0.4790 0.4673 0.46528 0.4473