

## 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

2015年3月31日

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

#### 5.1 重要提示

基金管理人的董事会及董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。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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、误导性陈述或者重大遗漏。  
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。  
基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。  
本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

#### 5.2 基金产品概况

基金名称 国投瑞银稳健增长混合  
基金代码 121006  
交易场所 深圳证券交易所  
基金运作方式 契约开放式  
基金合同生效日 2008年1月11日  
报告期末基金份额总额 902,867,473.90份  
投资目标 通过股票与债券等资产的合理配置,追求收益与风险的平衡,力求实现基金资产的长期稳定增值。  
投资策略 本基金将采取主动的资产配置策略,注重对“收益”的平衡。本基金遵循“稳健增长”投资策略,在严格控制风险的前提下,通过股票、债券和货币资产等资产的合理配置,追求基金资产的长期稳定增值。  
业绩比较基准 本基金根据各类资产的市场价格和预期收益风险的比较,对股票、债券和货币资产等资产的配置比例进行动态调整,以期使投资组合达到预期的收益目标。  
风险收益特征 本基金属于中等风险的类别资产,其预期收益和风险高于货币市场基金,但低于股票型基金。  
基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司  
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

#### 5.3 主要财务数据和净值增长表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日至2015年3月31日)
1.本期已实现收益	58,793,188.83
2.本期利润	136,483,040.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.1817
4.期末基金份额净值	817,087,701.43
5.期末基金份额持有人数	1,379

#### 5.4 本期基金份额持有人户数、持有人数及本期资产净值变动情况

单位:人民币元

阶段	净增值率①	户数②	持有人数③	期末资产净值④	
过去三个月	18.49%	1,206	8,986	1,175	0.09%

注:1.本基金属于股票型基金,一般情况下,本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
2.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
3.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
4.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
5.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
6.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
7.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
8.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
9.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
10.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
11.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
12.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
13.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
14.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
15.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
16.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
17.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
18.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
19.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
20.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
21.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
22.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
23.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
24.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
25.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
26.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
27.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
28.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
29.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
30.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
31.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
32.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
33.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
34.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
35.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
36.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
37.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
38.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
39.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
40.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
41.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
42.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
43.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
44.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
45.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
46.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
47.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
48.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
49.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
50.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
51.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
52.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
53.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
54.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
55.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
56.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
57.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
58.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
59.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
60.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
61.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
62.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
63.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
64.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
65.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
66.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
67.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
68.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
69.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
70.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
71.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
72.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
73.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
74.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
75.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
76.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
77.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
78.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
79.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
80.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
81.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
82.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
83.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
84.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
85.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
86.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
87.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
88.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
89.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
90.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
91.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
92.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
93.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
94.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
95.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
96.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
97.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
98.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
99.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。  
100.本基金按照前期末资产净值扣除基金费用后的净值乘以(1+收益)计算。

#### 5.5 投资组合报告

单位:人民币元

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	002790	亿阳信通	3,973,776	106,839,670.08	13.08
2	300253	卫宁软件	296,031	48,429,446.10	5.93
3	000829	天音控股	2,142,400	33,333,040.00	4.11
4	600030	中信证券	1,090,800	33,800,000.00	4.18
5	600837	海通证券	1,529,100	35,796,231.00	4.38
6	000800	一汽轿车	1,509,051	29,377,399.00	3.62
7	002384	齐力股份	1,999,856	28,757,929.28	3.52
8	300594	奥拓电子	1,226,749	28,074,202.38	3.44
9	002326	天农股份	897,983	21,856,302.18	2.67
10	601877	正海磁材	463,300	19,046,263.00	2.33

#### 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十名股票投资明细

单位:人民币元

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	002790	亿阳信通	3,973,776	106,839,670.08	13.08
2	300253	卫宁软件	296,031	48,429,446.10	5.93
3	000829	天音控股	2,142,400	33,333,040.00	4.11
4	600030	中信证券	1,090,800	33,800,000.00	4.18
5	600837	海通证券	1,529,100	35,796,231.00	4.38
6	000800	一汽轿车	1,509,051	29,377,399.00	3.62
7	002384	齐力股份	1,999,856	28,757,929.28	3.52
8	300594	奥拓电子	1,226,749	28,074,202.38	3.44
9	002326	天农股份	897,983	21,856,302.18	2.67
10	601877	正海磁材	463,300	19,046,263.00	2.33

#### 5.7 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

单位:人民币元

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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.8 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资产支持证券投资明细

单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.9 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权证投资明细

单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

#### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

#### 5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金报告期内无持有被质疑资产的情况。

#### 5.13 其他资产构成

单位:人民币元

序号	项目	金额
1	存出保证金	1,965,579.29
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,420,749.56
5	应收申购款	726,384.79
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,112,703.64

#### 5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位:人民币元

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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.15 报告期末持有的资产支持证券明细

单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.16 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

单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.17 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权证投资明细

单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.18 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

#### 5.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

#### 5.20 投资组合报告附注

5.20.1 本基金报告期内无持有被质疑资产的情况。

#### 5.21 其他资产构成

单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	646,600,853.54	71.20
2	债券投资	646,600,853.54	71.20
3	固定收益投资	40,015,000.00	4.44
4	货币资金	40,015,000.00	4.44
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	40,015,000.00	4.44
7	应收利息	1,420,749.56	0.16
8	其他资产	4,112,703.64	0.45
9	合计	901,815,475.07	100.00

#### 5.22 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

单位:人民币元

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	002790	亿阳信通	3,973,776	106,839,670.08	13.08
2	300253	卫宁软件	296,031	48,429,446.10	5.93
3	000829	天音控股	2,142,400	33,333,040.00	4.11
4	600030	中信证券	1,090,800	33,800,000.00	4.18
5	600837	海通证券	1,529,100	35,796,231.00	4.38
6	000800	一汽轿车	1,509,051	29,377,399.00	3.62
7	002384	齐力股份	1,999,856	28,757,929.28	3.52
8	300594	奥拓电子	1,226,749	28,074,202.38	3.44
9	002326	天农股份	897,983	21,856,302.18	2.67
10	601877	正海磁材	463,300	19,046,263.00	2.33

#### 5.23 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

单位:人民币元

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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.24 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

单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.25 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权证投资明细

单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	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国债29	100,000	10,003,000.00	1.22

#### 5.26 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

#### 5.27 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。

#### 5.28 投资组合报告附注

5.28.1 本基金报告期内无持有被质疑资产的情况。

#### 5.29 其他资产构成

单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	646,600,853.54	71.20
2	债券投资	646,600,853.54	71.20
3	固定收益投资	40,015,000.00	4.44
4	货币资金	40,015,000.00	4.44
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	40,015,000.00	4.44
7	应收利息	1,420,749.56	0.16
8	其他资产	4,112,703.64	0.45
9	合计	901,815,475.07	100.00

#### 5.30 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

单位:人民币元

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	002790	亿阳信通	3,973,776	106,839,670.08	13.08
2	300253	卫宁软件	296,031	48,429,446.10	5.9