

# 国投瑞银瑞易货币市场基金 2015 年第 2 季度报告

公告日期：2015-07-21

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

其他指标

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

公平交易专项说明

公平交易专项说明

公平交易制度和控制方法

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金投资策略和运作分析

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期债券回购融资情况

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

投资组合平均剩余期限基本情况

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

投资组合报告附注  
基金计价方法说明  
本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明  
受到调查以及处罚情况  
其他资产构成  
投资组合报告附注的其他文字描述部分  
开放式基金份额变动  
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细  
影响投资者决策的其他重要信息  
备查文件目录

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 7 月 17 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

## 项目数值

基金简称国投瑞银瑞易货币

场内简称-

基金主代码 000558

基金运作方式契约型开放式

基金合同生效日 2014-03-20

报告期末基金份额总额 39,055,670.91

投资目标本基金在优先考虑基金资产安全性和流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。

投资策略本基金主要采用流动性管理策略、资产配置策略，并适当利用交易策略，进行积极的投资组合管理。

业绩比较基准七天通知存款利率（税后）

风险收益特征本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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

## 主要财务指标

单位：人民币元

项目 2015-04-01 至 2015-06-30(元)

本期已实现收益 197,555.84

本期利润 197,555.84

期末基金资产净值 39,055,670.91

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段净值收益率①净值收益率标准差②业绩比较基准收益率③业绩比较基准收益率标准差④①-③②-④

过去三个月 0.4388%0.0023%0.3418%0%0.097%0.0023%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金的业绩比较基准中，通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期 7 天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。根据财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知（财税〔2008〕132 号）文件规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。故本基金本报告期以税前七天通知存款利率为业绩比较基准。

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

其他指标

单位：元

序号其他指标报告期（2015-04-01 至 2015-06-30）

序号其他指标报告期（2015-06-30）

#### 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名职务任本基金的基金经理期限证券从业年限说明

任职日期离任日期

徐栋本基金基金经理 2014-03-22-6 中国籍，硕士，具有基金从业资格。2009年7月加入国投瑞银，从事固定收益研究工作。现任国投瑞银货币市场基金、国投瑞银瑞易货币市场基金、国投瑞银钱多宝货币市场基金、国投瑞银增利宝货币市场基金和国投瑞银双债增利债券型基金基金经理。

颜文浩本基金基金经理 2014-09-02-5 中国籍，硕士，具有基金从业资格。2010年10月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞易货币基金、钱多宝货币基金、增利宝货币基金和添利宝货币基金基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银瑞易货币市场基金基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效的公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

## 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。本报告期内基金份额净值增长率高于基准，主要由于交易所回购价格较高。

### 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年二季度，随着经济下行压力继续增大，央行通过降息、降准、定向回购等方式扩大货币政策宽松力度，市场资金价格进一步下行；期间新股 IP 发行虽然对短端资金面有所扰动，但不改整体宽松态势，短端收益率下行显著。二季度，本基金以交易所回购为主，保持组合较高的流动性。

### 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，依据目前持续下行的经济状况，我们预计央行会保持宽松的货币政策，资金价格有望进一步走低。考虑该基金对流动性的要求，瑞易货币依旧以交易所回购为主，择机进行现券波段操作。

### 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金出现过连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，至本报告期末(6 月 30 日)仍低于 5000 万元，基金管理人依据相关规定在本报告中进行披露，提醒基金份额持有人关注。

### 报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号项目金额（元）占基金总资产的比例（%）

1 固定收益投资--

其中：债券--

资产支持证券--

2 金融衍生品投资--

3 买入返售金融资产 34,000,000.0066.46

其中：买断式回购的买入返售金融资产--

4 银行存款和结算备付金合计 17,149,125.0333.52

5 其他资产 12,358.030.02

6 合计 51,161,483.06100

### 报告期债券回购融资情况

金额单位：元

序号项目占基金总资产的比例（%）

1 报告期内债券回购融资余额-

其中：买断式回购融资-

序号项目金额（元）占基金总资产的比例（%）

## 2 报告期末债券回购融资余额--

其中：买断式回购融资--

注：本报告期间未发生债券回购融资交易。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

金额单位：元

序号发生日期融资余额占基金资产净值的比例（%）原因调整期

## 投资组合平均剩余期限基本情况

项目天数

报告期末投资组合平均剩余期限 2

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 5

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 0

注：本基金基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不超过 75 天。

本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 75 天的情况。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号发生日期平均剩余期限原因调整期

## 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号平均剩余期限各期限资产占基金资产净值的比例（%）各期限负债占基金资产净值的比例（%）

130 天以内 130.9630.73

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债--

230 天(含)—60 天--

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债--

360 天(含)—90 天--

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债--

490 天(含)—180 天--

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债--

5180 天(含)—397 天(含) --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债--

合计 130.9630.73

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：元

序号债券代码债券名称债券数量（张）摊余成本（元）占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 0

报告期内偏离度的最高值 0%

报告期内偏离度的最低值 0%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0%

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

序号债券品种摊余成本（元）占基金资产净值比例（%）

1 国家债券--

2 央行票据--

3 金融债券--

其中：政策性金融债--

4 企业债券--

5 企业短期融资券--

6 中期票据--

7 可转债--

8 其他--

9 合计--

9 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券--

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

单位：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（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明



本基金本报告期内无剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。  
受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

序号发生日期该类浮动债占基金资产净值的比例原因调整期

其他资产构成

单位：元

序号名称金额（元）

1 存出保证金-

2 应收证券清算款-

3 应收股利-

4 应收利息 12,358.03

5 应收申购款-

6 其他应收款-

7 待摊费用-

8 其他-

9 合计 12,358.03

投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目数值

报告期期初基金份额总额 62,150,840.37

报告期期间基金总申购份额 3,214,590.98

报告期期间总赎回份额 26,309,760.44

报告期期末基金份额总额 39,055,670.91

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份



序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2015-05-12	10786941.41	10798127.59	0
2	红利再投资	2015-04-20	22427.81	22427.81	0
合计			10809369.21	10820555.40	0

影响投资者决策的其他重要信息

报告期内本基金无其他重大事项。

备查文件目录

《关于核准国投瑞银瑞易货币市场基金募集的批复》（证监许可[2013]1646号）

《关于国投瑞银瑞易货币市场基金备案确认的函》（基金部函[2014]170号）

《国投瑞银瑞易货币市场基金基金合同》

《国投瑞银瑞易货币市场基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银瑞易货币市场基金 2015 年第二季度报告原文

存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

存放网址：<http://www.ubssdic.cm>

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：400-880-6868