

国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金2013年年度报告摘要

2013年12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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2014年3月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银瑞源保本混合
基金主代码	121010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	181,560,029.69
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求在有效控制风险的基础上，运用投资组合保险技术，为投资人提供保本周期到期时保本金额安全的保证，并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金持有的保本资产占基金资产的比例不低于60%。本基金持有的收益资产占基金资产的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p> <p>在保证资产配置符合《基金合同》规定的前提下，基金管理人将按照CPPI（Constant Proportion Portfolio Insurance）恒定比例组合保险策略和TIPP（Time Invariant Portfolio Protection）时间不变性投资组合保险策略的要求动态调整收益资产与保本资产的投资比例，在力求收益资产可能的损失额不超过安全垫的基础上，实现基金资产最大限度的增值。如在本基金存续期内市场出现新的金融衍生品且在开放式基金许可的投资范围之内，本基金管理人可以相应调整上述投资策略。</p> <p>保本资产主要投资策略包括：</p> <p>①持有相当数量剩余期限与保本周期相近的债券，主</p>

	<p>要按买入并持有方式进行投资以保证组合收益的稳定性，同时兼顾收益性和流动性，尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。</p> <p>②综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资，严格控制风险，增强盈利性，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。</p> <p>收益资产主要投资策略包括：一级市场新股申购策略、二级市场股票投资策略、权证投资管理、股指期货投资管理。</p>
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	关悦
	联系电话	400-880-6868	010-58560666
	电子邮箱	service@ubssdic.com	guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95568
传真		0755-82904048	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	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

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年12月20日-2011年12月31日
本期已实现收益	15,006,310.23	9,456,900.02	477,849.42
本期利润	8,872,991.61	12,125,960.01	603,310.45
加权平均基金份额本期利润	0.0402	0.0348	0.0013
本期基金份额净值增长率	3.33%	3.20%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0522	0.0253	0.0010
期末基金资产净值	191,036,440.99	285,323,081.15	464,832,492.58
期末基金份额净值	1.052	1.033	1.001

注：1、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。

2、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

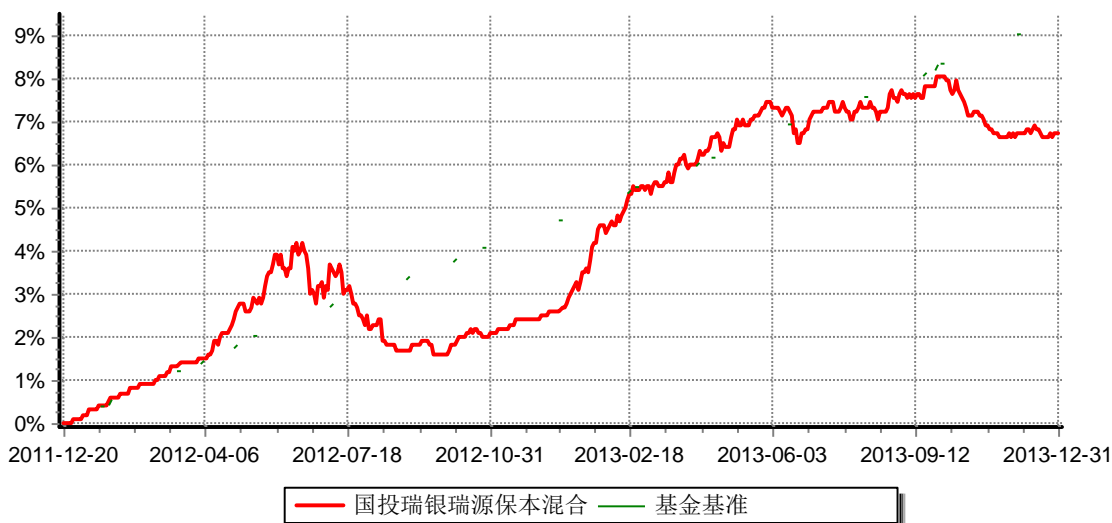
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.03%	0.08%	1.07%	0.01%	-2.10%	0.07%
过去六个月	-0.09%	0.09%	2.17%	0.01%	-2.26%	0.08%
过去一年	3.33%	0.11%	4.34%	0.01%	-1.01%	0.10%
自基金合同生效日起至今	6.74%	0.12%	9.44%	0.01%	-2.70%	0.11%

注：1、本基金是保本型基金，保本周期为三年，保本但不保证收益率。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

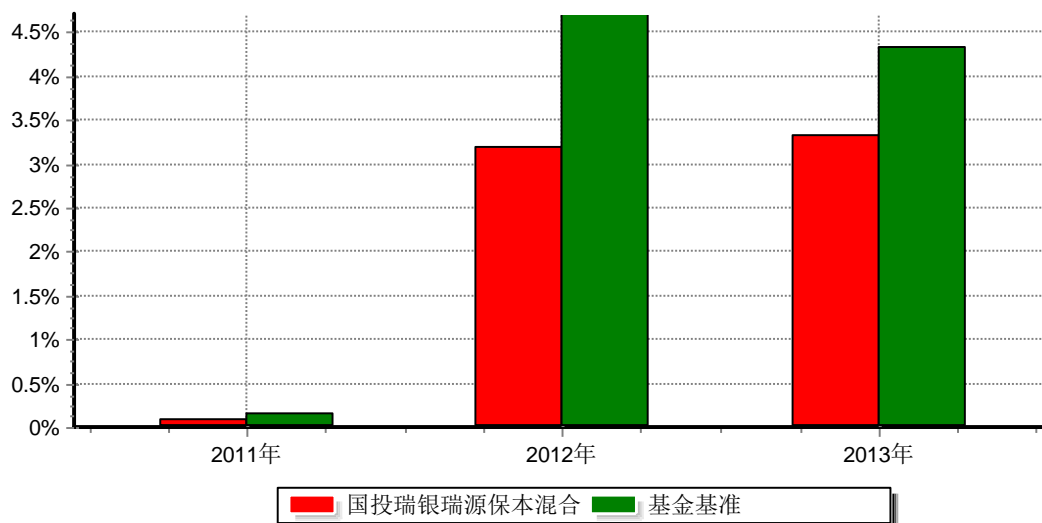
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2011年12月20日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	0.150	3,965,473.50	—	3,965,473.50	
2012年	—	—	—	—	
2011年	—	—	—	—	
合计	0.150	3,965,473.50	—	3,965,473.50	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本1亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司，公司股东为国投信托有限公司（国家开发投资公司的全资子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制架构，以“诚信、客户关注、包容性、社会责任”作为公司的企业文化。截止2013年12月底，公司有员工145人，其中88人具有硕士或博士学位；公司管理23只基金，其中包括2只创新型分级基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李怡文	本基金基金经理	2011年12月20日	—	13	中国籍，芝加哥大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任Froley Revy Investment Company分析师、中国建设银行（香港）资产组合经理。2008年6月加入国投瑞银，现兼任国投瑞银优化增强债券基金和国投瑞银纯债基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金合同》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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度，并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则：

- 1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时，坚持基金持有人利益优先；
- 2、当不同资产委托人利益发生冲突时，应公平的对待不同的资产委托人；
- 3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合；
- 4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下：

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程，提高投资管理的科学性和客观性，确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系，加强交易分配的内部控制，通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现，同时通过监察稽核，事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下：

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统，充分发挥系统的自动控制功能，根据公平交易管理的要求，在系统中设置相应业务流转顺序、控制阈值或者触发机制，对触及阈值的行为视情况分别

采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务自动执行必要的后续流程。如：符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易，内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理，控制阈值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动，通过建立明确的业务规则和流程，在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制，通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求，实现对关键业务风险的管理。如：以公司名义进行的一级市场申购结果分配，需要经过严格的公平性审核，由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后才为有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位，分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控，并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况，监督督促公平交易制度的执行。如：交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督，监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核，监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析，发现控制薄弱环节或交易价异常，将重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中，披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明，接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查，公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时，将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况，并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题，也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式，也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析，并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为，将依法采取相关监管措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，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，形成了有效地公平交易体系。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。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行T检验，检验在95%的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况，

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 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%的交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年中国债券走势先扬后抑，步入熊市。前5个月，由于流动性相对宽裕，经济弱复苏态势未能持续，债券市场整体表现良好，收益率下行幅度较大，利差继续收窄，信用产品表现优于利率产品。进入5月份以后，央行试图通过公开市场操作收紧流动性来达到促使金融机构去杠杆的目的，债券市场面对着非常不稳定的资金面，在资金需求较大的半年末曾出现隔夜回购利率高达30%的极端情况，临近年末7天回购利率则高达9%，债券市场遭受较大冲击。而2013年3季度以后，中国经济在企业补库存、政策稳增长的推动下出现一定幅度的反弹，进一步形成对债券市场的负面冲击。在资金面和基本面的

不利影响下，5月份以后债券市场的收益率急剧上升，大多数券种收益率上升幅度超过200bp,信用利差迅速扩大，收益率曲线明显平坦化，债券市场进入熊市。

本基金1季度降低了对中低评级债券的配置，1季度以后对包括转债在内的权益类资产保持低配，4季度以后，本基金适当增加对债券的资产配置，延长组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.052元，本报告期份额净值增长率为3.33%，同期业绩比较基准收益率为4.34%。基金净值增长率低于比较基准，主要是因为债券市场收益率大幅上行时，组合的久期较长，带来了一定的负贡献。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，利率市场化进程仍在发展，金融去杠杆持续，预计短期内利率难以趋势性下行，而影子银行业务的急剧扩张和地方政府债务的进一步膨胀增加了系统性风险，预计2014年的货币政策和财政政策的重点任务将落在防范风险和约束融资的快速扩张，货币政策难以明显放松。不过，中国经济持续持续回升乏力，通胀风险可控，基本面对债市的有利因素将逐渐增多。我们将密切关注债券市场的变化，保持组合流动性，灵活操作。股票市场方面，我们将在控制仓位的基础上，继续精选并持有估值合理、具有长期增长动力的优质个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估，并对基金估值程序进行监督；估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等事项，估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以及监察稽核部指定人员；运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，设立基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关成员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。

本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值小组提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管行沟通，在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为15,006,310.23元，期末可供分配利润为9,476,411.30元。

本基金于2013年1月18日以2012年12月31日基金已实现的可分配收益为基准，实施收益分配3,965,473.50元，每10份基金份额分红0.15元。

本基金于2014年1月16日以2013年12月31日基金已实现的可分配收益为基准，实施收益分配8,971,377.90元，每10份基金份额分红0.50元。

报告期本基金的利润分配符合法律法规的相关规定和《基金合同》的约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金于2013年1月18日以2012年12月31日基金已实现的可分配收益为基准，实施收益分配3,965,473.50元，每10份基金份额分红0.15元。**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

经普华永道中天会计师事务所审计，注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日

资产：		
银行存款	1,515,048.24	2,185,570.03
结算备付金	139,373.91	3,813,607.95
存出保证金	30,643.89	250,000.00
交易性金融资产	278,813,446.04	388,660,755.97
其中：股票投资	5,008,691.44	12,483,331.80
基金投资		
债券投资	273,804,754.60	376,177,424.17
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	887,413.08	2,948,853.22
应收利息	4,036,225.21	5,067,052.04
应收股利	—	—
应收申购款	890.62	1,286.47
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	285,423,040.99	402,927,125.68
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	93,019,729.32	116,199,741.20
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	328,688.52	654,885.76
应付管理人报酬	200,450.26	297,630.30
应付托管费	33,408.41	49,605.05
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	8,962.77	17,835.89

应交税费	297,633.20	31,841.20
应付利息	85,227.64	28,899.22
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	412,499.88	323,605.91
负债合计	94,386,600.00	117,604,044.53
所有者权益：		
实收基金	181,560,029.69	276,220,487.25
未分配利润	9,476,411.30	9,102,593.90
所有者权益合计	191,036,440.99	285,323,081.15
负债和所有者权益总计	285,423,040.99	402,927,125.68

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.052元，基金份额总额181,560,029.69份。

7.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日-2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日 -2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年 12月31日
一、收入	14,235,135.78	19,258,295.83
1.利息收入	9,282,339.03	15,647,401.69
其中：存款利息收入	85,428.92	5,039,565.40
债券利息收入	8,909,643.31	10,340,679.98
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	287,266.80	267,156.31
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	10,697,774.03	-30,338.60
其中：股票投资收益	4,500,867.69	-5,470,782.73

基金投资收益		
债券投资收益	6,057,616.38	4,866,123.77
资产支持证券投资收 益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	139,289.96	574,320.36
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	-6,133,318.62	2,669,059.99
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	388,341.34	972,172.75
减：二、费用	5,362,144.17	7,132,335.82
1. 管理人报酬	2,798,489.69	4,299,961.63
2. 托管费	466,415.01	716,660.27
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	88,204.24	306,364.16
5. 利息支出	1,601,371.16	1,402,869.52
其中：卖出回购金融资产支出	1,601,371.16	1,402,869.52
6. 其他费用	407,664.07	406,480.24
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）	8,872,991.61	12,125,960.01
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）	8,872,991.61	12,125,960.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日-2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
	2013年1月1日-2013年12月31日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	276,220,487.25	9,102,593.90	285,323,081.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	8,872,991.61	8,872,991.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-94,660,457.56	-4,533,700.71	-99,194,158.27
其中：1.基金申购款	3,536,613.36	177,207.72	3,713,821.08
2.基金赎回款	-98,197,070.92	-4,710,908.43	-102,907,979.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	-3,965,473.50	-3,965,473.50
五、期末所有者权益(基金净值)	181,560,029.69	9,476,411.30	191,036,440.99
项 目	上年度可比期间		
	2012年1月1日-2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	464,229,182.13	603,310.45	464,832,492.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	12,125,960.01	12,125,960.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-188,008,694.88	-3,626,676.56	-191,635,371.44
其中：1.基金申购款	5,024,030.47	81,777.23	5,105,807.70
2.基金赎回款	-193,032,725.35	-3,708,453.79	-196,741,179.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益	276,220,487.25	9,102,593.90	285,323,081.15

（基金净值）		
--------	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘纯亮

刘纯亮

冯伟

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]第1638号《关于核准国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第492号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金合同》于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为464,229,182.13份基金份额,其中认购资金利息折合68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止为基金第一个保本期(如保本周期届满的最后一日为非工作日,则保本周期到期日顺延至下一个工作日)。在保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其认购保本金额,则本基金的基金管理人补足该差额,并由担保人中国投资担保有限公司提供不可撤销的连带责任担保。保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金将继续存续并转入下一保本周期;在不符合保本基金存续条件下,本基金将变更为"国投瑞银瑞源灵活配置混合型证券投资基金"。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、货币市场工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资对象主要分为两类:保本资产和收益资产。保本资产主要包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券

（含分离交易可转债）、次级债、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种。收益资产主要包括股票、权证以及股指期货等权益类品种。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金持有的保本资产占基金资产的比例不低于60%。本基金持有的收益资产占基金资产的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）

本财务报表由本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司于2014年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本期采用的会计政策、会计估计与上年度可比期间相一致。

7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣

代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司("民生银行")	基金托管人、基金代销机构
国投信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东
国投瑞银资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
国投瑞银资本管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,798,489.69	4,299,961.63
其中：支付销售机构的	832,451.49	1,311,433.45

客户维护费		
-------	--	--

注：支付基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	466,415.01	716,660.27

注：支付基金托管人 民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12 月31日
期初持有的基金份额	30,001,916.67	30,001,916.67
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	30,001,916.67	30,001,916.67
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	16.52%	10.86%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日-2013年12月31日		2012年1月1日-2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	1,515,048.24	43,784.30	2,185,570.03	2,643,521.51

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，活期存款部分按银行同业利率计息，定期存款部分按协议利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本期末2013年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额47,119,729.32元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
100236	10国开36	2014-01-02	98.83	400,000	39,532,000.00
120409	12农发09	2014-01-02	99.12	80,000	7,929,600.00
合计				480,000	47,461,600.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末2013年12月31日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额45,900,000.00元，分别于2014年1月3日、1月7日、1月14日及1月17日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为81,576,446.04元，属于第二层级的余额为197,237,000.00元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级152,837,355.97元，第二层级235,823,400.00元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层

级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,008,691.44	1.75
	其中：股票	5,008,691.44	1.75
2	固定收益投资	273,804,754.60	95.93
	其中：债券	273,804,754.60	95.93
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	1,654,422.15	0.58
6	其他各项资产	4,955,172.80	1.74
7	合计	285,423,040.99	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	5,008,691.44	2.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—

E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	5,008,691.44	2.62

8.3 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

金额单位：人民币元

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	002415	海康威视	120,900	2,778,282.00	1.45
2	600079	人福医药	70,400	1,995,840.00	1.04
3	002236	大华股份	5,738	234,569.44	0.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站（<http://www.ubssdic.com>）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	002550	千红制药	5,041,505.60	1.77
2	002415	海康威视	2,300,264.10	0.81
3	000998	隆平高科	2,216,934.00	0.78
4	600079	人福医药	2,216,548.00	0.78
5	002450	康得新	1,789,807.92	0.63
6	002251	步步高	1,463,544.36	0.51
7	300136	信维通信	1,409,745.00	0.49
8	601318	中国平安	1,300,314.00	0.46
9	002236	大华股份	1,163,029.00	0.41
10	600104	上汽集团	1,152,778.00	0.40

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002550	千红制药	6,431,306.23	2.25
2	002073	软控股份	4,513,049.43	1.58
3	600066	宇通客车	3,299,002.73	1.16
4	002437	誉衡药业	2,807,486.30	0.98
5	000998	隆平高科	2,117,968.38	0.74
6	300259	新天科技	1,775,932.43	0.62
7	300136	信维通信	1,537,743.98	0.54
8	002450	康得新	1,495,550.86	0.52
9	002251	步步高	1,483,078.57	0.52
10	601318	中国平安	1,205,157.71	0.42
11	600104	上汽集团	1,156,397.34	0.41
12	002236	大华股份	1,087,442.60	0.38
13	000527	美的电器	533,810.00	0.19
14	601933	永辉超市	484,743.51	0.17
15	002273	水晶光电	348,000.00	0.12

16	002661	克明面业	316,500.00	0.11
17	300016	北陆药业	306,210.85	0.11
18	600867	通化东宝	52,821.31	0.02

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	20,054,469.98
卖出股票的收入（成交）总额	30,952,202.23

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	68,444,000.00	35.83
	其中：政策性金融债	68,444,000.00	35.83
4	企业债券	75,989,994.60	39.78
5	企业短期融资券	79,727,000.00	41.73
6	中期票据	49,066,000.00	25.68
7	可转债	577,760.00	0.30
8	其他	—	—
9	合计	273,804,754.60	143.33

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	100236	10国开36	400,000	39,532,000.00	20.69
2	126013	08青啤债	240,570	23,739,447.60	12.43

3	041354059	13宁沪高 CP001	200,000	19,860,000.00	10.40
4	130422	13农发22	200,000	19,000,000.00	9.95
5	122051	10石化01	170,090	16,430,694.00	8.60

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券中,持有"10石化01"市值1,643万元, 占基金资产净值8.60%; 根据中国石油化工股份有限公司2013年11月25日公告, 该公司位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂, 导致原油泄漏事故并造成人员死伤, 中国政府已派出事故调查组进行全面调查。基金管理人认为, 本调查对该公司经营活动未产生实质性影响, 不改变该公司基本面, 但管理人会持续关注该事项的调查进展。

本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

除上述情况外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.11.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,643.89
2	应收证券清算款	887,413.08
3	应收股利	—
4	应收利息	4,036,225.21
5	应收申购款	890.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,955,172.80

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
2,296	79,076.67	33,407,225.12	18.40%	148,152,804.57	81.60%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基 金	11,837.00	0.01%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。
2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月20日)基金份额总额	464,229,182.13
本报告期期初基金份额总额	276,220,487.25
本报告期基金总申购份额	3,536,613.36
减：本报告期基金总赎回份额	98,197,070.92
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	181,560,029.69

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动如下：

自2013年2月21日起，包爱丽女士转任公司副总经理，不再担任督察长；由刘凯先生担任公司督察长。

自2013年3月29日起路博先生不再担任公司副总经理，由王书鹏先生接任。

自2013年5月2日起刘纯亮先生正式担任公司总经理。

上述人事变动均已按法律法规要求在指定媒体予以披露。

本基金托管人2013年7月13日发布公告，根据业务需要，聘任杨春萍为中国民生银行资产托管部副总经理（主持工作），同时解聘刘溥棠中国民生银行资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金连续提供审计服务2年。报告期内应支付给该事务所的报酬为60,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	40,138,909.61	78.69%	36,191.22	78.53%	
中信证券	1	10,867,762.60	21.31%	9,893.97	21.47%	

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期未发生交易所权证交易。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例
平安证券	2,680,423.47	0.76%	—	—
中信证券	350,949,274.07	99.24%	4,147,900,000.00	100.00%

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日