

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
送出日期:2013年3月27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。本基金的报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签章。

1.2 本托管人就国投瑞银股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置情况、财务会计报告、投资组合报告等信息，保证复核后的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财产，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当仔细阅读本基金的招募说明书。

2013年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金简称	国投瑞银优化增强债券
基金主代码	121012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年09月08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
报告期末基金份额总额	551,001,288.13份
基金合同存续期间	不适用
下属分级基金的基金简称	国投瑞银优化增强债券A/B/C
下属分级基金的交易代码	121012(前端)/128012(后端)
报告期末下属分级基金的份额总额	350,259,517.57份 200,771,770.56份

2.2 基金产品说明

投资目标 在追求本基金资产稳定性、有效控制风险和保持资金流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，寻求获得高于行业平均水平的稳定收益。

本基金的投资对象具有良好的流动性，金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。

本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股，也可以在一二级市场上买卖股票、权证等其他类资产。

本基金对类属资产的投资比例不超过基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；其中中长期国债的平均到期收益率不超过一年的定期存款利率的一倍。

风险收益特征 本基金为债券型基金，属证券投资基金中的最低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合基金和股票型基金。

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 中国建设银行股份有限公司

姓名 包丽丽 田青

信息披露负责人 联系电话 400-880-6868 010-67595096

电子邮箱 service@ubssdc.com tianjing.lzh@ecbcb.com

客户服务电话 400-880-6868 010-67595096

传真 0755-82904048 010-66725865

注:2013年2月23日基金管理人公告,自2013年2月21日起包丽丽女士转任公司副总经理,不再担任督察长,由朱生担任公司督察长。

4.4 信息来源及披露方式

本基金的定期报告在指定报刊上披露,并同时在本公司网站上披露。

4.5 信息披露义务人的声明

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

4.6 基金管理人和基金托管人对年度报告的保证声明

基金管理人和基金托管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的法律责任。

4.7 基金管理人对年度报告的评价意见

本基金管理人对年度报告整体表示满意,对基金管理人履行受托责任的评价是肯定的。

4.8 管理人对报告年度基金运作的回顾分析

2012年,随着全球经济和金融市场形势的复杂多变,本基金在严格遵守法律法规的前提下,通过积极主动的投资管理,较好地实现了投资目标。

4.9 管理人对报告年度基金业绩的评价

本基金在2012年实现了较好的投资回报,超额完成了年初制定的绩效目标。

4.10 管理人对报告年度基金费用的评价

本基金在2012年未发生任何费用。

4.11 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.12 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.13 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.14 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.15 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.16 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.17 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.18 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.19 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.20 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.21 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.22 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.23 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.24 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.25 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.26 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.27 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.28 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.29 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.30 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.31 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.32 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.33 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.34 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.35 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.36 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.37 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.38 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.39 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.40 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.41 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.42 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.43 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.44 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.45 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.46 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.47 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.48 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.49 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.50 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.51 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.52 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.53 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.54 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

4.55 管理人对报告年度基金内部控制的评价

本基金在2012年未发生任何内部控制方面的费用。

4.56 管理人对报告年度基金监察稽核的评价

本基金在2012年未发生任何监察稽核方面的费用。

4.57 管理人对报告年度基金投资研究的评价

本基金在2012年未发生任何投资研究方面的费用。

4.58 管理人对报告年度基金市场营销的评价

本基金在2012年未发生任何市场营销方面的费用。

4.59 管理人对报告年度基金客户服务的评价

本基金在2012年未发生任何客户服务方面的费用。

4.60 管理人对报告年度基金风险管理的评价

本基金在2012年未发生任何风险管理方面的费用。

<p