

国投瑞银银优化增强债券型证券投资基金

2013 第 季 度 报 告

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:2013年4月22日

基金管理人及基金托管人承诺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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年4月18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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告自2013年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况	国投瑞银优化增强债券
基金简称	国投瑞银优化增强债券
基金代码	121012
交易代码	121012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月8日
报告期末基金份额总额	547,993,805.86份
投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取稳健灵活的资产配置策略,通过固定收益类金融工具的组合管理,力求降低基金净值波动风险,并根据对宏观经济和债券市场利率及新股申购收益预期,适度参与一级市场新股和增发新股的申购以及一级市场的新股投资,力求提高基金总体收益率。
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属二级基金的基础简称	国投瑞银优化增强债券A/B
下属二级基金的交易代码	121012(前隔)/128012(后隔)
报告期末下属二级基金的份额总额	372,529,639.05份 175,464,166.81份

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
主要财务指标	国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C
1.本期已实现收益	6,084,887.97 3,288,429.21
2.本期利润	11,030,854.93 5,242,878.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0336 0.0302
4.期末基金资产净值	392,858,067.06 183,127,203.62
5.期末基金份额净值	1.0551 1.0441

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.以上所述基金净值指标不包括有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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.1 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

国投瑞银优化增强债券A/B

阶段	净值增长率①	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	3.33%	0.24%	0.35%	0.16%	2.98%	0.08%

国投瑞银优化增强债券C

阶段	净值增长率①	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	3.16%	0.26%	0.35%	0.16%	2.81%	0.10%

注:1.本基金以中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%作为业绩比较基准。中债总指数收益率是指中债综合全价指数收益率,该指数每日复盖了上海证券交易所银行间以及银行间债券市场的主要固定收益类资产,具有广泛的代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。沪深300指数是指上海证券交易所编制的反映上海证券交易所上市的所有证券的综合价格水平,具有广泛的市场代表性,适合作为中国A股市场整体走势的基准,因此本基金选择沪深300指数作为本基金股票投资业绩比较基准。

2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较采用日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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

本基金A/B类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:1.本基金合同于2010年9月8日生效。根据合同约定,本基金管理人自基金合同生效日起6个月内执行基金的资产配置比例符合基金合同的相关规定。建仓期结束后,本基金管理人严格执行基金合同约定的资产配置比例。

2.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

3.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

4.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

5.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

6.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

7.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

8.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

9.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

10.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

11.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

12.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

13.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

14.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

15.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

16.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

17.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

18.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

19.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

20.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

21.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

22.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

23.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

24.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

25.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

26.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

27.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

28.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

29.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

30.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

31.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

32.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

33.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

34.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

35.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

36.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

37.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

38.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

39.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

40.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

41.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

42.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

43.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

44.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

45.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

46.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

47.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

48.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

49.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

50.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

51.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

52.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

53.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

54.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

55.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

56.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

57.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

58.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

59.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

60.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

61.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

62.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

63.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

64.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

65.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

66.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

67.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

68.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

69.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

70.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

71.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

72.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

73.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

74.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

75.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

76.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

77.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

78.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

79.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

80.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

81.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

82.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

83.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

84.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

85.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

86.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

87.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

88.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

89.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

90.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

91.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

92.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

93.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

94.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

95.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

96.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

97.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

98.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

99.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

100.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

基金产品概况	国投瑞银优化增强债券
基金简称	国投瑞银优化增强债券
基金代码	121012
交易代码	121012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月8日
报告期末基金份额总额	547,993,805.86份
投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取稳健灵活的资产配置策略,通过固定收益类金融工具的组合管理,力求降低基金净值波动风险,并根据对宏观经济和债券市场利率及新股申购收益预期,适度参与一级市场新股和增发新股的申购以及一级市场的新股投资,力求提高基金总体收益率。
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属二级基金的基础简称	国投瑞银优化增强债券A/B
下属二级基金的交易代码	121012(前隔)/128012(后隔)
报告期末下属二级基金的份额总额	372,529,639.05份 175,464,166.81份

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
主要财务指标	国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C
1.本期已实现收益	6,084,887.97 3,288,429.21
2.本期利润	11,030,854.93 5,242,878.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0336 0.0302
4.期末基金资产净值	392,858,067.06 183,127,203.62
5.期末基金份额净值	1.0551 1.0441

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.以上所述基金净值指标不包括有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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.1 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

国投瑞银优化增强债券A/B

阶段	净值增长率①	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	3.33%	0.24%	0.35%	0.16%	2.98%	0.08%

国投瑞银优化增强债券C

阶段	净值增长率①	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	3.16%	0.26%	0.35%	0.16%	2.81%	0.10%

注:1.本基金以中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%作为业绩比较基准。中债总指数收益率是指中债综合全价指数收益率,该指数每日复盖了上海证券交易所银行间以及银行间债券市场的主要固定收益类资产,具有广泛的代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。沪深300指数是指上海证券交易所编制的反映上海证券交易所上市的所有证券的综合价格水平,具有广泛的市场代表性,适合作为中国A股市场整体走势的基准,因此本基金选择沪深300指数作为本基金股票投资业绩比较基准。

2.本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较采用日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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

本基金A/B类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:1.本基金合同于2010年9月8日生效。根据合同约定,本基金管理人自基金合同生效日起6个月内执行基金的资产配置比例符合基金合同的相关规定。建仓期结束后,本基金管理人严格执行基金合同约定的资产配置比例。

2.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

3.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

4.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

5.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

6.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

7.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

8.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

9.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

10.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

11.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

12.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

13.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

14.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

15.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

16.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

17.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

18.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

19.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

20.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

21.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

22.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

23.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

24.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

25.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

26.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

27.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

28.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

29.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

30.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

31.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

32.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

33.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

34.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

35.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

36.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

37.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

38.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

39.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

40.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

41.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

42.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

43.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

44.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

45.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

46.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

47.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

48.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

49.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

50.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

51.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

52.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

53.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

54.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

55.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

56.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

57.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

58.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

59.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

60.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

61.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

62.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

63.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

64.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

65.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

66.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

67.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

68.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

69.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。

70.截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。截至本报告期末,本基金资产配置符合基金合同约定的资产配置比例。