


国投瑞银货币市场基金

注：截至本报告期末，该资产组合前十大重仓个股投资占比占基金资产净值约80.7%，其中投资占比净值比例61.0%。债券投资占比净值比例3.38%，现金和到期日不超过1年的政府债券等资产基金净值比例0.03%，符合基金合同的相关规定。

4.1 基金经理或基金经理助理简介

4.1.1 基金经理

姓名	职务	在本基金的基金经理任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
倪文昊	本基金基金经理	2013年5月11日	-	8	中国籍，管理学学士，具有基金从业资格。曾任上海证券业国际投资集团；2009年7月起加入国泰君安。曾任国投瑞银收入基金和国投瑞银基金基金助理助理。现兼任国投瑞银中证下游消费与服务指数基金(LOF)

5.6 报告期内前十大公允价值变动资产和负债比例大于10%的前五大公允价值投资资产					金额单位：人民币元
序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	090407	09宏发07	1,000,000	100,120,000.00	2.46
2	110015	石化转债	383,190	37,510,469.10	0.92

5.6 报告期内前十大公允价值变动资产和负债比例大于10%的前五大资产支持证券投资明细
 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.7 报告期内前十大公允价值变动资产和负债比例大于10%的前五名权益类投资资产
 本基金报告期内未持有权益类资产。

5.8 报告期内本基金投资的股指期货交易情况
 本基金报告期内未投资股指期货。

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 本基金报告期内未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资的股指期货持仓损益说明
 本基金报告期内未投资股指期货。

5.8.3 股指期货持仓损益说明
 根据本基金合同规定, 本基金不参与股指期货期货交易。

3.1 主要财务指标		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期间	2013年07月01日至2013年09月30日	
		国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
1.本期已实现收益	2,637,348.78	43,775,508.64	
2.本期利息收入	2,637,348.78	43,775,508.64	
3.本期公允价值变动	229,800.08	3,428,952.94	
注:1、上述基金资产净值(不包括持有交易易金融资产的摊余成本,计入摊余成本公允价值变动)水平等于前列数字			
2、本期公允价值变动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)扣除相关税费后的余额,公允价值变动指基金本期公允价值变动收益(损失)减去公允价值变动损益采用公允价值变动损益扣除公允价值变动收益后的余额			

2	30天(含)~60天	15.58	
	其中:剩余存单期限超过397天的浮动利率债	-	
3	60天(含)~90天	6.57	
	其中:剩余存单期限超过397天的浮动利率债	2.20	
4	90天(含)~180天	7.11	
	其中:剩余存单期限超过397天的浮动利率债	-	
5	180天(含)~397天(含)	8.48	
	其中:剩余存单期限超过397天的浮动利率债	-	
	合计	99.36	
5.4 按债券到期偿付频率划分的债券投资组合			

[illegible]

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,931,534.24
2	应收证清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	765,236.81
5	应收申购款	95,444.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,792,215.53

[illegible]

序号	债券代码	债券名称	持仓公允价值 (元)	持仓公允价值 占净值比例 (%)
1	141350024	13国债附息CP01	1,000,000	100.176, 2.74
2	100029	10附息09	1,000,000	100.149, 2.73
3	130210	13国债10	1,000,000	99.987, 536.99
4	100212	10附息12	800,000	80.126, 2.58
5	130161008	13国债零息CP01	800,000	80.128, 289.17
6	130201	13国债01	700,000	70.005, 07.24
7	090106	09附息06	500,000	50.157, 1.37
8	150253069	12国债附息CP01	500,000	50.114, 593.18
9	0904016	13国债附息CP01	500,000	50.014, 944.62
10	130201	13国债01	400,000	40.020, 686.27

本机构的对外投资主要围绕医药产业链上下游进行。

2019年3月4日,我们认为,受新冠疫情影响,国内防疫政策趋于严格,疫苗价格趋于下降,但明显是利好医药产业链上游的疫苗研发企业,而下游的疫苗生产企业则可能受到不利影响。同时,由于疫情影响,国内防疫物资需求量大,防疫物资生产企业可能受到利好,从而带动防疫物资产业链的上升。

我们认为,在疫情影响下,国内防疫物资需求量大,防疫物资生产企业可能受到利好,从而带动防疫物资产业链的上升。同时,由于疫情影响,国内防疫政策趋于严格,疫苗价格趋于下降,但明显是利好医药产业链上游的疫苗研发企业,而下游的疫苗生产企业则可能受到不利影响。

5.1 报告期内基金资产组合情况

5.2 投资组合报告

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,282,692,659.42	79.46

[illegible]

5.8.2 本基金本报告披露前无固定期限小于397天且剩余存续期超过397天的浮动利率债券的余额未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 本基金本报告披露前无固定期限大于等于397天且剩余存续期大于等于397天的浮动利率债券的余额未超过前一日基金资产净值的20%。

5.8.4 本基金本报告披露前无固定期限大于等于397天且剩余存续期大于等于397天的浮动利率债券的发行主体本期末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。

5.8.5 本基金本报告披露前构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收利息	25,464,559.23
4	应收申购款	
5	其他应收款	8,100.00

4.1 基金管理人基金经理人				
姓名	职务	在本基金的基金经理期限 (任职日期)	证券从业年限	说明
陈翔凯	本基金基金 固定收益 总监	2012年09月15日	-	16

并降低基金管理人运用基金财产导致投资亏损的追索时间限制,已获回款需按出资比例和出资比例升降顺序进行分配。

3. 基金管理人运用自有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生自有资金投资本公司管理基金的情况。

4. 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内基金管理人成立子公司,公司对外投资基金管理人自有资金进行基金投资,指定媒体公告时间为2013年8月13日。

报告期内基金管理人对于本基金首次发行未获申购,转换为现金,大额定期定额投资业务进行公告,指定媒体公告时间为2013年11月13日。

5. 备查文件目录

(一) 核准证券投资基金市场基金募集的批复《证监许可[2010]1423号》

(二) 中国证监会核准基金募集的确认函《基金部函[2009]27号》

(三) 基金管理人市场基金备案材料

人：人员包括普通投资者和机构投资者。普通投资者是指在中国境内依法设立并存续、产品面向公开发行的资产管理产品，包括公募基金、信托计划、券商资产管理计划、期货资管计划、银行理财产品等，其数量不受限制，其资产不受限制。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其系列法规、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规、监管规定和公司内部制度，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，切实防范利益冲突，切实维护投资者合法权益，实现了公平对待投资组合，无重大违规事实的发生。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

《基金招募说明书》全文及招募说明书摘要。
 国际互联网上刊登有本基金管理人、托管人、销售机构、公司网址及基金管理人业务资料附件。
 投资者可在本中国证监会指定信息披露网站或基金管理人网站浏览、下载或打印有关信息。原
 则上，投资者应通过中国证监会指定的信息披露网站（www.csrc.gov.cn）获取有关信息。

9.2 存放地点
 本基金的招募说明书存放在深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

9.3 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

国投招商银基金管理有限公司
 二〇一三年十月二十三日