

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  
报告送出日期：2013年10月23日

**§ 1 重要提示**  
基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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。  
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月21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。  
基金过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期中财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金

基金主代码 121010

基金运作方式 约定开放式基金

基金合同生效日 2011年12月20日

报告期末基金份额总额 201,082,785.09份

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，为投资者提供本周期内保本收益的理财产品，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金持有的货币市场基金资产比例不低于10%，本基金持有的股票、债券等其他金融资产的比例不超过40%，其余基金资产的净值比例不得低于基金资产净值的30%。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%。

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)定价定比、定期调整保本期限和TIPS(Interest Rate Portfolio Protection Strategy)定价定比的两种方法来实现保本产品的投资目标，在力求收益资产之前的损失都不超过安全垫的基础上，实现基金资产的最大限度的增值。如本基金存续期内市场出现新的衍生品时，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回避上述投资策略。

本基金主要投资策略包括：

（1）货币市场类投资策略：一级市场新股申购策略、二级市场股票投资策略、权证投资策略、股指期货投资管理策略。

（2）债券类投资策略：流动性和风险性、择时操作、投资策略、严控风险、增强流动性，以争取取得相对稳定的收益，提高整体组合的稳定性。

（3）股票类投资策略：一级市场新股申购策略、二级市场股票投资策略、权证投资策略、股指期货投资管理策略。

业绩比较基准 3年期银行存款利率（税后）+0.5%

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。

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

基金保证人 中国投资担保有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 1,628,474.36

2.本期利润 2,193,870.55

3.加权平均基金份额本期利润 0.0104

4.期末基金份额净值 213,804,395.00

5.期末基金净值增长率 -1.063

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

阶段 净值增长 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长 业绩比较基准 纯益增长  
率(①) 率(②) 率(③) 率(④)  
过去三个月 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

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，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、减去基金管理费、托管费后的余额，基金净值增长率=本期利润/期末基金份额净值。

2.以上各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，例如基金申购赎回费、基金转换费等，以上各项基金业绩指标不适用于所有投资者。

3.2.1 本基金业绩比较基准采用每日平均收益率的比较方法。