

(上接B054版)

联系人:张晋北
客服电话:400-666-2288
公司网站:www.jhzq.com.cn
(56)华宝证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人:陈林
电话:021-68777222
传真:021-68777222
联系人:刘闻川
客服电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com
(57)财富证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人:孙智勇
电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:郭磊
客服电话:0731-84403350
公司网站:www.czqz.com
(58)方正证券股份有限公司
住所:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人:雷杰
电话:0731-85832503
传真:0731-85832214
联系人:郭军瑞
客服电话:95571
公司网站:www.foundersc.com
(59)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
电话:010-63081000
传真:010-63080978
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
(60)宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
电话:010-88085185
传真:010-88085195
联系人:李巍
客服电话:4008-000-562
公司网站:www.hysec.com
(61)国联证券股份有限公司
住所:江苏省无锡县前东街168号国联大厦6层
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702

法定代表人:姚志勇
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:沈刚
客服电话:95570
公司网站:www.glsc.com.cn
(62)中国国际金融有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦28层28层
法定代表人:金立群
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联系人:罗春香、肖婷
公司网站:www.cicc.com.cn
(63)华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87383600
传真:0591-87383610
联系人:张宗锐
客服电话:96326(福建省外加拨0591)
公司网站:www.hfzq.com.cn
(64)中航证券有限公司
住所:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层
办公地址:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层

法定代表人:杜航
电话:0791-96768681
传真:0791-96770178
联系人:戴雷
客服电话:400-8866-567
公司网站:www.avicsec.com
(65)华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
法定代表人:李晓安
电话:0931-4890208
传真:0931-48901628
联系人:李昕田
客服电话:400-689-8888,0931-96668
公司网站:www.hljzqs.com
(66)中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:010-84868888
传真:010-84865560
联系人:陈忠
客服电话:95548
公司网站:www.cs.citic.com
(67)华融证券股份有限公司
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:宋德清
电话:010-58568235
传真:010-58568284
联系人:黄恒
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn
(68)中原证券股份有限公司
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
电话:0371-65858670
传真:0371-65858665
联系人:程月梅
客服电话:967218,400-813-9666
公司网站:www.ccnew.cn
(69)厦门证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
联系人:赵欣
客服电话:0592-5163588
公司网站:www.xmzq.com
(70)爱建证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址:上海市浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼

法定代表人:宫龙云
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:戴利刚
客服电话:021-63340678
公司网站:www.aijzq.com
(71)财达证券有限责任公司
住所:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层

法定代表人:崔建强
电话:0311-66006403
传真:0311-66006201
联系人:胡士光
客服电话:4006128888
公司网站:www.s10000.com
(72)民生证券股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

法定代表人:余政
电话:010-85127999
联系人:赵明
客服电话:400-619-8888
公司网站:www.msxzq.com
(73)东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区兴阳街5号
办公地址:苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
法定代表人:范力
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:方晓丹
客户服务电话:4008-601-555
网址:www.dwzq.com.cn
(74)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦11楼
法定代表人:张维锋
电话:0755-82047857
传真:0755-82835785
联系人:陈婉华
客户服务电话:95563
网址:www.ghzq.com.cn
(75)联讯证券有限责任公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
电话:0752-2119391
传真:0752-2119396
联系人:郭晴
客户服务电话:400-8888-929
(76)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
电话:021-64339000
传真:021-64333051
联系人:陈敏
客服电话:021-32109999,029-68918888
公司网站:www.cfsc.com.cn
(77)浙商证券股份有限公司
住所:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
法定代表人:吴承根
电话:021-64310572
传真:021-64713795
客服电话:0571-967777
公司网站:www.stocke.com.cn
(78)深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦1、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦1、J单元
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
联系人:童彩平
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn及www.jimw.com
(79)上海好买基金销售有限公司
住所:上海是虹口区场中路685弄37号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-20613999
传真:021-68596916
联系人:张茹
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
(80)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦城大道555号裕景国际B座4楼
法定代表人:张庆伟
电话:021-20691835
传真:021-20691861
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com
(81)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38602377
传真:021-38509777
联系人:方成
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(82)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:021-6089 7869,0571-2882 9790
传真:0571-26669533
联系人:张裕
客服电话:4000-766-123
公司网站:market.fund123.cn
(83)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
办公地址:上海市龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
公司网站:www.1234567.com.cn
(84)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民生大厦20层
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911183-8653
传真:0571-86800424
联系人:胡璇 杨翼
客服电话:0571-86800423
公司网站:www.5ifund.com
(86)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王利
电话:021-20835779
传真:021-20835885
联系人:于杨
客服电话:400-920-0022
公司网站:licaik.ehexun.com
(87)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
住所:北京市朝阳区建国路89号9层15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809室
法定代表人:沈伟桦
电话:010-52857133
传真:010-58594278
联系人:程刚
客服电话:400-6099-500
公司网站:www.yixinfund.com
(88)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
电话:010-66045152
传真:010-66045518
联系人:尹伶
客服电话:010-66045678
天相视频网址:http://www.txsec.com
天相基金网网址:www.jim.com.cn
(89)上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人:申健
电话:021-20219988
传真:021-20219923

联系人:付江
客服电话:021-20219931
公司网站:www.wg.com.cn
3、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)注册登记机构
名称:国投瑞银基金管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路638号7层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人:钱蒙
电话:(0755)83575836
传真:(0755)82912534
联系人:冯伟
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:梁丽金、刘佳
联系人:梁丽金
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛竞、叶尔甸
联系人:刘蜀

四、基金的目标
本基金名称:国投瑞银优化增强债券型证券投资基金。
五、基金的类型
本基金类型:债券型。基金运作方式:契约型、开放式。
六、基金的投资目标
在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上,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。
七、基金的投资方向
本基金的投资对象是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、权证及法律法规和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。本基金既可以参与一级市场新股申购或增发新股,也可以在二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的90%;股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中权证投资的比例不超过基金资产净值的3%;持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。投资比例将遵从法律法规或监管机构的限制。
八、基金的投资策略
1、资产配置
本基金采取稳健灵活的投资策略,通过固定收益类金融工具的主动管理,力求降低基金净值波动风险,并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测,适度参与一级市场新股和增发新股的申购以及二级市场的股票投资,力求提高基金总体收益率。
2、债券类资产的投资管理
本基金借鉴UBS Global AM固定收益组合的管理方法,采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。
(1)评估资产配置
债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线(Equilibrium Yield Curves)。
均衡收益率曲线是所有相关的风险都得到补偿时,收益率曲线的合理位置。风险补偿包括四个方面:资金的时间价值(补偿)、通货膨胀补偿、期限补偿、流动性及信用风险补偿。
本基金基于均衡收益率曲线,计算不同资产类别、不同剩余期限债券品种的预期超额回报,并对预期超额回报进行排序,得到投资评级。
(2)选择投资策略
债券投资策略主要包括:久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同时期,以上策略组合收益和风险的贡献不尽相同,具体采用何种策略,取决于债券组合允许的风险程度。
(3)可转换债券的投资管理
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本面优良的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具进行定价。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。
(4)资产支持证券等的投资管理
资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本分析和债券市场宏观分析的基础上,辅以数量化模型确定其内在价值。
(5)组合构建及调整
由公司投资主管和债券负责人组成债券策略组。该小组将借鉴UBS Global AM债券研究方法,结合各成员债券投资管理经验,评估债券价格与内在价值偏离幅度是否可靠,据此构建债券模拟组合。
债券策略组每周开会讨论债券策略组合、买入低估值债券,卖出高估债券。同时从风险管理的角度,评估组合调整对组合久期、类别权重等的影响。
随着债券市场的发展与金融创新的深入,以及相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时,本基金将基于审慎的原则,在满足本基金投资目标的前提下适时调整基金投资范围和投资比例。
(6)风险管理与归因分析
国投瑞银借鉴UBS Global AM全球风险管理系统(GRS)方法管理债券组合风险。GRS方法关注组合风险来源,包括久期、剩余期限、汇率和信用特征。把组合总体风险分解为市场风险、发行人特定风险和汇率风险等。
3、股票投资策略
(1)一级市场新股申购策略
本基金将在评估新股申购收益与风险状况的基础上参与新股申购。在进行新股申购时,基金管理人将结合金融工程数量化模型,使用QEVS模型等方法评估股票的内在价值,充分借鉴券商等外部资源的研究成果,对于拟发行上市的新股(或增发新股)等权益类资产价值进行深入发掘,评估申购收益率,并通过对于申购资金的积极管理,制定相应的申购和降时卖出策略以获取较好投资收益。
本基金结合发行市场资金状况和近期新股上市首日表现、预测股票上市后的市场价格、分析和比较申购收益率和中签率,从而决定是否参与新股申购和参与金额。
一般情况下,本基金对获配新股将在可流通之首日起即择机卖出,以控制基金净值的波动。若可流通初期价格低于合理估值,则会等待至价格上升至合理价位时卖出。
(2)二级市场股票投资策略
基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会,在本基金合同约定范围内直接投资二级市场股票,努力获取超额收益。在股票投资方面,基金管理人将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。
基金管理人除了在剔除流动性差或公司经营存在重大问题且近期无解决方案的上市公司股票后,形成股票初选库。在稳健投资方面,基金管理人以现金流充裕、行业竞争优势明显、具有良好现金分红记录或分红潜力的优质公司作为主要投资目标。在灵活投资方面,则以主题投资为主线,着重投资在中国经济增长进程和股票市场发展中均有代表性的投资主题所覆盖的优质上市公司股票。
在形成可执行组合之前,组合需经风险考量和风险调整。基金管理人借鉴GRS等风险管理技术系统,对模拟组合(事前)和实际投资组合(事后)进行风险评估、绩效归因分析,从而确定可执行组合以及组合调整策略。
九、基金的投资比较基准
中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上海的主要固定收益类证券,具有广泛的代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。
沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,具有权威性,适合作为本基金股票投资业绩比较基准。
本业绩比较基准符合本基金的投资风格,并反映本基金的风险收益特征。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,基金管理人可以在与基金托管人协商一致,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,属于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。
十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2014年6月30日,本报告中列示的数据未经审计。
1、报告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	19,482,353.09	3.26
其中:股票	19,482,353.09	3.26	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	519,255,935.63	86.87
其中:债券	519,255,935.63	86.87	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,500,000.00	3.43
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	29,422,483.95	4.92
8	其他各项资产	9,102,031.96	1.52
9	合计	597,762,804.63	100.00

2、报告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	5,622,664.58	1.33
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	13,859,688.51	3.28
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		19,482,353.09	4.61

3、报告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	601318	中国平安	249,235	9,804,904.90	2.32
2	000025	长安汽车	377,423	4,646,077.13	1.10
3	601336	新华保险	191,897	4,054,783.61	0.96
4	000551	格力电器	35,241	3,617,275.45	0.82
5	600328	领益智造	1,093	15,310.00	0.00

注:截止报告期末本基金仅持有以上股票。
4、报告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	国债债券	2,531,088.00	0.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,895,000.00	7.08
其中:政策性金融债	29,895,000.00	7.08	
4	企业债券	303,658,569.08	71.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	91,061,000.00	21.55
7	可转债	92,110,278.55	21.80
8	其他	-	-
9	合计	519,255,935.63	122.90

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	120903	12国债(票)	300,000	30,402,000.00	7.21
2	101451002	14农发01	300,000	30,339,000.00	7.18
3	130422	13农发22	300,000	29,895,000.00	7.08
4	122165	12国债(票)	252,270	25,055,456.40	5.93
5	110020	南山转债	251,950	23,045,328.00	5.67

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。
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。
11、投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名证券中,包括“平安转债”市值2,158万元,占基金资产净值5.11%;根据中国平安保险(集团)股份有限公司2013年10月15日公告,该集团控股子公司“平安证券有限责任公司”收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》,决定对平安证券有限责任公司责令改正给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处人民币5,110万元的罚款,暂扣其保荐业务许可3个月。基金管理人认为,平安证券发行业务承销佣金收入及投行业务收入占该集团营业收入及集团的净利润的比重较小,本处罚对该集团经营活动没有产生实质性影响,未改变该集团基本面,本基金对该证券的投资决策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也未受到公开谴责、处罚。
(2)本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。
(3)期末其他各项资产构成
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,522.22
2	应收证券清算款	169,133.54
3	应收股利	-
4	应收利息	8,722,482.22
5	应收申购款	186,864.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,102,031.96

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	23,045,328.00	5.67
2	113005	民生转债	21,577,640.00	5.11
3	110023	民生转债	14,662,400.00	3.47
4	113007	民生转债	13,246,400.00	3.21
5	113002	民生转债	5,059,200.00	1.20
6	122002	徐工转债	4,697,586.22	1.12
7	110015	石化转债	3,242,339.10	0.77
8	125809	原化转债	3,024,316.23	0.72
9	110017	中南转债	936,400.00	0.22
10	110018	国电转债	521,800.00	0.12
11	110022	国电转债	114,580.00	0.03

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	期末受限部分公允价值	占基金资产净值比例(%)	期末受限原因
1	601038	领益智造	-	0.00	新股上市

(6)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。
十二、基金的投资
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
基金净值表现详见下表:
国投瑞银优化增强债券型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
2010.09.08 (基金合同生效日至2010.12.31)	0.70%	0.20%	-2.38%	0.21%	3.08%	-0.01%
2011.01.01至2011.12.31	-4.87%	0.29%	-0.45%	0.16%	-4.42%	0.13%
2012.01.01至2012.12.31	6.58%	0.30%	0.31%	0.14%	6.27%	0.16%
2013.01.01至2013.12.31	1.96%	0.16%	-5.33%	0.18%	7.29%	-0.02%
2014.01.01至2014.06.30	7.78%	0.13%	3.12%	0.14%	4.66%	-0.01%
自基金合同生效日至至今	12.20%	0.24%	-4.84%	0.16%	17.04%	0.08%

国投瑞银优化增强债券型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
2010.09.08 (基金合同生效日至2010.12.31)	0.60%	0.20%	-2.38%	0.21%	2.98%	-0.01%
2011.01.01至2011.12.31	-5.27%	0.29%	-0.45%	0.16%	-4.82%	0.13%
2012						