

国投瑞银融华债券型证券投资基金

2013年第四个季度报告

基金单位: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	113002	工行转债	553,850	56,132,697.50	10.08
2	130311	13进出口11	500,000	49,540,000.00	8.90
3	100414	10农发16	300,000	29,094,000.00	5.23
4	130201	13国开01	200,000	19,998,000.00	3.59
5	110310	11进出口10	200,000	19,884,000.00	3.57

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

本基金本报告期内未持有权证。

5.8 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的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未受到过公开谴责、处罚。

5.10.2 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。

5.10.3 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	154,324,005
2	应收证券清算款	18,975,557.08
3	应收股利	3,316,974.74
4	应收利息	135,730.38
5	其中:买入式回购的买入返售金融资产	-
6	应付申购款	-
7	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	22,582,886.25

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金单位: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	113002	工行转债	56,132,697.50	10.08
2	130111	13进出口11	500,000	49,540,000.00
3	100414	10农发16	300,000	29,094,000.00
4	130201	13国开01	200,000	19,998,000.00
5	110310	11进出口10	200,000	19,884,000.00

5.10.5 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	154,324,005
2	应收证券清算款	18,975,557.08
3	应收股利	3,316,974.74
4	应收利息	135,730.38
5	其中:买入式回购的买入返售金融资产	-
6	应付申购款	-
7	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	22,582,886.25

5.10.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金单位: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	113002	工行转债	56,132,697.50	10.08
2	130111	13进出口11	500,000	49,540,000.00
3	100414	10农发16	300,000	29,094,000.00
4	130201	13国开01	200,000	19,998,000.00
5	110310	11进出口10	200,000	19,884,000.00

5.10.7 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

5.10.8 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

本基金本报告期内未持有权证。

5.10.9 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

5.10.10 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名证券的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未受到过公开谴责、处罚。

5.10.11 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。

5.10.12 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。

5.10.13 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	154,324,005
2	应收证券清算款	18,975,557.08
3	应收股利	3,316,974.74
4	应收利息	135,730.38
5	其中:买入式回购的买入返售金融资产	-
6	应付申购款	-
7	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	22,582,886.25

5.10.14 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

本基金本报告期内未持有权证。

5.10.15 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

5.10.16 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名证券的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未受到过公开谴责、处罚。

5.10.17 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。

5.10.18 期末其他各项资产构成

单位:份

序号	名称	金额
1	存出保证金	440,324,024.86
2	报告期末基金份额总额	43,464,562.93
3	报告期末基金份额总额	45,975,437.62
4	报告期末基金份额总额	-
5	报告期末基金份额总额	437,813,150.17

5.10.19 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

5.10.20 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

本基金本报告期内未持有权证。

5.10.21 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

5.10.22 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名证券的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未受到过公开谴责、处罚。

5.10.23 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。

5.10.24 期末其他各项资产构成

单位:份

序号	名称	金额
1	存出保证金	440,324,024.86
2	报告期末基金份额总额	43,464,562.93
3	报告期末基金份额总额	45,975,437.62
4	报告期末基金份额总额	-
5	报告期末基金份额总额	437,813,150.17

5.10.25 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

5.10.26 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

本基金本报告期内未持有权证。

5.10.27 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股指期货交易情况说明

根据本基金合同约定,本基金不参与股指期货交易。

5.10.28 本报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名证券的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未受到过公开谴责、处罚。

5.10.29 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。

5.10.30 期末其他各项资产构成

单位:份

序号	名称	金额
1	存出保证金	45,628.22
2	报告期末基金份额总额	-
3		