国投瑞银货币市场基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 日

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

送出日期:2011年08月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证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的法律责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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代表其未来表现。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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文 。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银货币	
基金主代码	121011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年01月19日	
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	
报告期末基金份额总额	2,697,802,400.73	
下属两级基金的基金简称	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
下属两级基金的交易代码	121011	128011
报告期末下属两级基金的份额总额	276,047,008.11	2,421,755,392.62

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求基金资产安全性和较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下,依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期,综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	业绩比较基准=七天通知存款的税后利率:(1-利息税率)×七天通知存款利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	包爱丽	赵会军
	联系电话	400-880-6868	010-66105799
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年01月01日-2011年06月30日)	
	A级	B级
本期已实现收益	3,435,312.60	20,248,893.46
本期利润	3,435,312.60	20,248,893.46
本期净值收益率	1.4581%	1.5788%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2011年01月01日-2011年06月30日)	
期末基金资产净值	276,047,008.11	2,421,755,392.62
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

(1)国投瑞银货币A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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2356%	0.0029%	0.1242%	0.0000%	0.1114%	0.0029%
过去三个月	0.7429%	0.0046%	0.3759%	0.0001%	0.3670%	0.0045%
过去六个月	1.4581%	0.0048%	0.7210%	0.0002%	0.7371%	0.0046%
过去一年	2.5090%	0.0044%	1.4184%	0.0002%	1.0906%	0.0042%
自基金合同生效日起至今	4.2120%	0.0045%	3.4464%	0.0001%	0.7656%	0.0044%

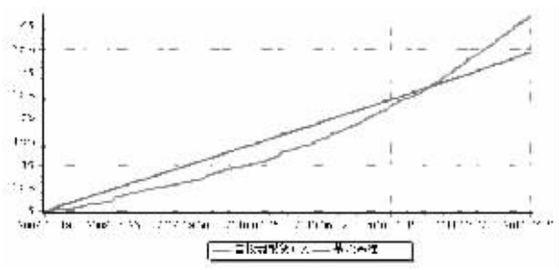
(2)国投瑞银货币B基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2555%	0.0029%	0.1242%	0.0000%	0.1313%	0.0029%
过去三个月	0.8032%	0.0047%	0.3759%	0.0001%	0.4273%	0.0046%
过去六个月	1.5788%	0.0048%	0.7210%	0.0002%	0.8578%	0.0046%
过去一年	2.7552%	0.0044%	1.4184%	0.0002%	1.3368%	0.0042%
自基金合同生效日起至今	4.8273%	0.0045%	3.4464%	0.0001%	1.3809%	0.0044%

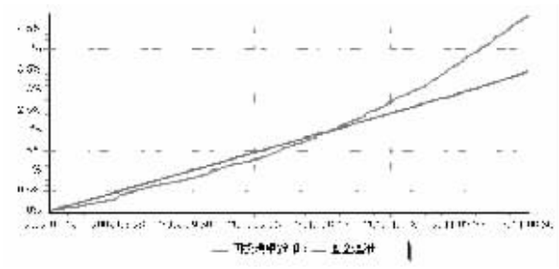
注:本基金的业绩比较基准中,通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期7天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。根据财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知《财税〔2008〕132号》文件规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。故本基金以税前七天通知存款利率为业绩比较基准。

3.2.4 自基金合同生效以来基金份额累计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

(1)国投瑞银货币A自基金合同生效以来基金份额累计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



(2)国投瑞银货币B自基金合同生效以来基金份额累计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



注:截至本报告期末各项资产配置比例分别为债券投资占基金资产净值比例30.90%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例6.73%,符合基金合同相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司(简称"公司"),原中融基金管理有限公司,经中国证券监督管理委员会批准,于2002年6月13日正式成立,注册资本1亿元人民币,注册地深圳。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司,公司股东为国投信托有限公司(国家开发投资公司的全资子公司)及瑞士银行股份有限公司(UBS AG)。公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效的风险管理及控制架构,以"诚信、客户关注、包容性、社会责任"作为公司的企业文化。公司现有员工161人,其中91人具有硕士或博士学位。截止2011年6月底,公司管理15只基金,其中包括2只创新型分级基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩海平	本基金基金经理、固定收益组副总监	2009年01月19日	-	8	中国籍,经济学硕士,管理科学和计算机科学与技术双学士,具有基金从业资格。CFA和CARP会员,金融风险管理师FRM资格。曾任职于招商基金。2007年5月加入国投瑞银。曾任融鑫基金基金经理、现兼任国投瑞银稳定增利基金和国投瑞银双债增利基金基金经理。
李达夫	本基金基金经理	2011年06月30日	-	5	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任职于东莞市农村商业银行。2008年4月加入国投瑞银,先后任职于交易部、基金投资部、从事债券交易、研究工作。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银货币市场基金基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内,基金的投资决策规范,基金运作合法合规,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,本公司未管理其他投资风格与本基金相似的投资组合,不存在投资风格相似的不同投资组合之间的业绩表现差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,针对依然严峻的通胀形势,央行货币政策继续收紧,连续六次上调存款准备金率合计3个百分点,并加息0.5个百分点。受央行紧缩货币政策的影响,货币信贷增速持续回落,中国宏观经济有明显放缓迹象。

货币市场方面,由于存款准备金率连续上调和银行机构节假日流动性备付以及月末、季末报表因素的影响,市场资金面一直趋紧,隔夜以及7天回购利率创出08年以来新高。在融资成本居高不下的情况下,债券收益率节节上升。一级市场方面,3个月期央票发行收益上行107bp至3.08%;1年期央票上行约99bp至3.5%水平。短融方面,一二级市场价差缩窄,信用利差大幅扩大。本期内货币基金降低了逆回购和定期存款比例,增加了短融和浮息金融债配置,延长了剩余期限。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A级份额净值增长率为1.46%,B级份额净值增长率为1.58%,同期业绩比较基准收益率为0.72%。本期内基金份额净值增长率高于基准,主要是本期内货币市场利率上升,运营环境改善。

4.5 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断本轮通胀周期较长、CPI回落速度较慢,即使中国经济如我们预期在三季度继续回落,短期内央行的货币政策仍难以放松。考虑到下半年公开市场到期资金较少,央行会减少上调存款准备金率次数,更倾向于通过公开市场操作平滑到期资金量,预计三季度银行间回购利率会比目前水平有明显下降。基于对宏观经济和债券市场的判断,本基金将适当拉长投资组合剩余期限,调整短期融资券以及政策性金融债投资结构,并增加对短期融资券投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估,并对基金估值程序进 行监督;估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等 事项,估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以 及监察稽核部指定人员;运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策, 设立基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关成员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果, 并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职 业敏感,向估值小组提供估值参考信息、参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的 证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管行沟通,在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每月集中支付。每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。

本基金国投瑞银货币A本期已实现收益为3,435,312.60元, 国投瑞银货币B本期已实现收益为20,248,893.46元,已全部在每日通过利润分配方式分配完毕。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年上半年,本基金托管人在对国投瑞银货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

2011年上半年,国投瑞银货币市场基金的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银货币市场基金2011年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国投瑞银货币市场基金

报告截止日:2011年06月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年06月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款		630,307,855.36	1,192,464,651.35
结算备付金			1,304,545.45
存出保证金		119,047.63	-
交易性金融资产		833,667,430.18	631,106,346.12
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		833,667,430.18	631,106,346.12
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		1,046,202,541.30	2,055,404,189.70
应收证券清算款		50,734,627.64	-
应收利息		7,810,940.10	5,744,190.11
应收股利		-	-
应收申购款		130,047,688.12	57,251,969.62
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,698,890,130.33	3,943,275,892.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年06月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	315,000,000.00
应付赎回款		267,157.02	14,384.06
应付管理人报酬		401,568.92	460,547.03
应付托管费		121,687.52	139,559.69
应付销售服务费		72,932.46	34,839.51
应付交易费用		24,596.69	16,663.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		199,786.99	94,663.51
负债合计		1,087,729.60	315,760,656.85
所有者权益:			
实收基金		2,697,802,400.73	3,627,515,235.50
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,697,802,400.73	3,627,515,235.50
负债和所有者权益总计		2,698,890,130.33	3,943,275,892.35

注:报告截止日2011年6月30日,国投瑞银货币A和国投瑞银货币B份额净值均为1.000元,基金份额总额2,697,802,400.73份,其中国投瑞银货币A 276,047,008.11份,国投瑞银货币B 2,421,755,392.62份。

6.2 利润表

会计主体:国投瑞银货币市场基金

本报告期:2011年01月01日-2011年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期2011年01月01日-2011年06月30日	上年度可比期间2010年01月01日-2010年06月30日
一、收入		28,694,404.30	13,306,081.71
1.利息收入		28,718,442.25	11,786,576.26
其中:存款利息收入		9,374,505.82	2,383,407.20
债券利息收入		12,414,808.24	6,397,103.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,929,128.19	3,006,065.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-44,037.95	1,519,505.45
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-44,037.95	1,519,505.45
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		20,000.00	-
减:二、费用		5,010,198.24	3,489,794.44
1.管理人报酬		2,578,587.43	2,306,810.65
2.托管费		781,390.10	699,033.54
3.销售服务费		371,088.89	217,258.41
4.交易费用		-	-
5.利息支出		1,050,982.90	44,040.42
其中:卖出回购金融资产支出		1,050,982.90	44,040.42
6.其他费用		228,148.92	222,651.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		23,684,206.06	9,816,287.27
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		23,684,206.06	9,816,287.27

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国投瑞银货币市场基金

本报告期:2011年01月01日-2011年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年01月01日-2011年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,627,515,235.50	-	3,627,515,235.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,684,206.06	23,684,206.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-929,712,834.77	-	-929,712,834.77
其中:1.基金申购款	8,136,039,783.44	-	8,136,039,783.44
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-9,065,752,618.21	-	-9,065,752,618.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-23,684,206.06	-23,684,206.06
五、期末所有者权益(基金净值)	2,697,802,400.73	-	2,697,802,400.73
	上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日		
项 目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	6,249,106,465.80	-	6,249,106,465.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,816,287.27	9,816,287.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-5,538,407,570.34	-	-5,538,407,570.34
其中:1.基金申购款	2,898,525,287.66	-	2,898,525,287.66
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-8,436,932,858.00	-	-8,436,932,858.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-9,816,287.27	-9,816,287.27
五、期末所有者权益(基金净值)	710,698,895.46	-	710,698,895.46

6.4 报表附注

6.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生关联交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2011年01月01日-2011年06月30日	上年度可比期间2010年01月01日-2010年06月30日
当期应支付的管理费	2,578,587.43	2,306,810.65
其中:应支付给销售机构的客户维护费	236,276.68	208,424.52

注: 支付基金管理人国投瑞银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2011年01月01日-2011年06月30日	上年度可比期间2010年01月01日-2010年06月30日
当期应支付的托管费	781,390.10	699,033.54

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年01月01日-2011年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B	合计
国投瑞银基金管理有限公司	77,575.21	48,442.60	126,017.81
中国工商银行股份有限公司	68,640.98	3,185.14	71,826.12
合计	146,216.19	51,627.74	197,843.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2010年01月01日-2010年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B	合计
国投瑞银基金管理有限公司	25,342.36	39,628.90	64,971.26
中国工商银行股份有限公司	77,784.02	2,161.43	79,945.45
合计	103,126.38	41,790.33	144,916.71

注: 支付基金销售机构的国投瑞银货币A和国投瑞银货币B的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值0.25%和0.01%的年费率计提。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率 / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期2011年01月01日-2011年06月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	29,994,000.00	70,039,238.17				
	上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	10,079,987.12				

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本期及上年度可比期间未持有本基金份额。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本期末及上年末未持有本基金份额。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2011年01月01日-2011年06月30日		上年度可比期间2010年01月01日-2010年06月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国工商银行股份有限公司	80,307,855.36	202,259.27	17,767,441.06	352,892.98

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2011年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为质押的债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	固定收益投资	833,667,430.18	30.89
	其中:债券	833,667,430.18	30.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,046,202,541.30	38.76
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	630,307,855.36	23.35
4	其他资产	188,712,303.49	6.99
5	合计	2,698,890,130.33	100.00

7.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金总资产的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.80	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

金额单位:人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2011-01-31	21.55	巨额赎回	2011-02-10
2	2011-02-01	21.56	巨额赎回	2011-02-10
3	2011-02-09	21.56	巨额赎回	2011-02-10

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

注:本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	58.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.12	-
3	60天(含)-90天	8.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.86	-
4	90天(含)-180天	6.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		94.93	-

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	343,337,016.11	12.73
	其中:政策性金融债	343,337,016.11	12.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	490,330,414.07	18.18
6	其他	-	-
7	合计	833,667,430.18	30.90
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	242,233,493.62	8.98

7.5期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	070211	07国开11	1,000,000	101,103,522.49	3.75
2	090407	09农发07	800,000	81,162,264.45	3.01
3	070219	07国开19	800,000	80,754,297.90	2.99
4	110217	11国开17	500,000	50,153,828.32	1.86
5	1181012	11华能CP01	400,000	40,069,797.95	1.49
6	1181219	11中铝CP01	400,000	40,030,310.88	1.48
7	1181217	11正大CP01	400,000	40,013,912.60	1.48
8	110206	11国开06	300,000	30,163,102.95	1.12
9	1181107	11酒钢CP01	300,000	30,100,479.85	1.12
10	1181208	11浙小商CP02	300,000	30,066,477.12	1.11

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1755%
报告期内偏离度的最低值	-0.1646%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1172%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

7.8.2 本基金本报告期内无剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况

7.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.8.4 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	119,047.63
2	应收证券清算款	50,734,627.64
3	应收利息	7,810,940.10
4	应收申购款	130,047,688.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	188,712,303.49

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

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的权证,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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
A级	3,534	78,111.77	50,407,802.17	18.26%	225,639,205.94	81.74%
B级	59	41,046,701.57	2,369,206,330.86	97.83%	52,549,061.76	2.17%
合计	3,593	750,849.54	2,419,614,133.03	89.69%	278,188,267.70	10.31%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	A级	68,452.39	0.02%
	B级	-	-
	合计	68,452.39	0.00%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
基金合同生效日(2009年01月19日)基金份额总额	1,425,014,004.60	2,407,948,888.01
本报告期期初基金份额总额	150,232,587.29	3,477,282,648.21
本报告期基金总申购份额	1,551,712,839.00	6,584,326,944.44
减:本报告期基金总赎回份额	1,425,898,418.18	7,639,854,200.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	276,047,008.11	2,421,755,392.62

注:总申购份额含红利再投、转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额,总赎回份额含转换出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

§10 重大事件