

**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**  
**送出日期:2012年8月30日**

**§1 重要提示**

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、基金管理人中国民生银行股份有限公司根据基金合同约定,于2012年8月23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。  
 本报告期自2012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**

基金名称	国投瑞银瑞源保本混合
基金代码	121010
交易代码	121010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	333,396,700.11
基金合同存续期	不定期

**2.2 基金产品说明**

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,为投资人提供保本,以期在长期时保持本金安全的前提下,并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金持有的保本资产占基金资产的比例不低于40%。本基金持有的收益资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的金融资产的市值不超过基金资产净值的30%。本基金持有现金或者到期在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

在证券资产估值过程中,基金合同约定的前提下,基金管理人按照CPPI Constant Proportion Portfolio Insurance 模型进行组合保险策略的动态调整,以确保与保本资产的投资比例,在力求收益资产可能的损失不超过安全垫的前提下,本基金资产净值不低于初始本金。如果本基金持有的股票出现异常的波动,基金管理人可在开放式基金资产的投资范围之内,本基金管理人可以相应调整上述投资组合。

本基金主要投资策略包括:  
 1. 保持相当数量现金类资产与保本资产相近的债券,主要买入并持有方式,进行资产保值或收益的稳定性,以期实现收益和保本,并可能根据利率、收益率曲线等各种因素,进行资产配置调整。  
 2. 在控制风险的前提下,进行主动管理,主要指根据市场利率和信用状况,进行债券品种的择时和配置,严格控制风险,调整期限,以争取取得适当的超额收益,提高整体组合收益。  
 3. 本基金主要投资策略包括:在严格控制风险的前提下,进行主动管理,主要指根据市场利率和信用状况,进行债券品种的择时和配置,严格控制风险,调整期限,以争取取得适当的超额收益,提高整体组合收益。  
 4. 本基金主要投资策略包括:在严格控制风险的前提下,进行主动管理,主要指根据市场利率和信用状况,进行债券品种的择时和配置,严格控制风险,调整期限,以争取取得适当的超额收益,提高整体组合收益。

**业绩比较基准**  
 三年期银行定期存款利率(税后)

**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。

**§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**

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	中国民生银行股份有限公司
负责人	包爱丽	关悦
联系电话	400-880-6868	010-58560666
电子邮箱	service@ubsic.com	gmyue@cmbc.com.cn
客户服务电话	400-880-6868	95566
传真	0755-82904088	010-58560798

**3.2 基金净值表现**

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准偏离度③	①-③	②-④
过去一个月	-0.48%	0.25%	0.39%	0.01%	-0.87%
过去三个月	1.67%	0.17%	1.23%	0.01%	0.44%
过去六个月	3.10%	0.13%	2.49%	0.02%	0.61%
自基金合同生效日起至今	3.20%	0.12%	2.60%	0.02%	0.54%

注:1、本基金是保本型基金,保本周期为三年,保本但不保证收益率,以三年期银行定期存款税后收益作为本基金的业绩比较基准,能够使本基金保本投资人合理判断本基金的风险收益特征,合理地衡量比较本基金保本的有效性。  
 2、本基金对业绩比较基准采用日加权平均的计算方法。  
 3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、本基金基金合同生效日为2011年12月20日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间不满一年。根据基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至报告期期末各项资产配置比例符合基金合同约定。  
 2、截至本报告期末各项资产配置比例分别为股票投资占基金净值比例12.87%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例83.49%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例13.17%,符合基金合同的有关规定。

**§4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及基金情况**

**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,注册地上海。公司是中国第一家外资持股比例达到49%的合资基金管理公司,公司股东为中国信托有限公司(国家开发投资基金的子公司)及瑞士银行有限公司(UBS AG)。公司拥有完善的人事治理制度,建立了有效的风险管理及控制制度,以“诚信、客户至上、包容性、社会责任”作为公司的企业文化,公司现有员工154人,其中92人具有硕士或博士学位。截止2012年6月底,公司管理18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日期	证券从业年限	说明
李伟光	本基金经理	2011年12月20日	11	中国籍,毕业于加拿大工商管理硕士,具有基金从业资格,曾任 Fidelity Reserve Investment Company 中国区总经理,2008年6月加入国投瑞银,曾任国投瑞银旗下理财产品基金经理。

注:1、任职日期和离任日期均以公司对外公示的公告之日为准。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。  
 2、管理人在本报告期末基金运作期间守信情况的说明  
 在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金合同》等有关规定,本基金恪守诚信、勤勉、客观、忠实、尽责的原则,勤勉尽责,没有损害基金份额持有人的利益的行为。  
 4.3 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、流程和技术手段保障公平交易制度的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面得到公平对待,通过对投资交易行为的实时监控,对异常交易行为和异常交易情况进行及时的监督和管控,形成有效的公平交易机制。本报告期内,本基金管理人各项公平交易制度均得到较好地贯彻执行,未发生存在违反公平交易制度的现象。  
 4.3.2 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,也未出现与管理人管理的其他所有组合参与交易所公开竞价同日反向交易及较少单边交易且超过该证券市值当日成交5%的情况。  
 4.4 管理人对外报告期末基金投资组合及业绩表现的说明  
 4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明  
 2012年上半年,中国经济增速继续放缓,根据最新公布的经济数据,2季度中国GDP同比增长7.6%,增速比1季度回落0.5个百分点,环比增长1.8%,较1季度回升0.2个百分点。从单月经济数据来看,经济增速也出现一些企稳的迹象,其中工业增加值在4月份回升,环比增幅达到1.2%,而此前连续两个月回落,环比增幅为负。随着通胀回落,大宗商品价格大幅回落,通胀压力大幅缓解,6月份CPI同比回落至2.2%,而PPI同比增幅为负,4月份CPI同比增长,通胀回落,央行执行货币政策大幅宽松,上半年下调存款准备金率两次合计1个百分点,在6月份之后降息两次合计50bp,货币端明显宽松回升。受以上因素的综合影响,上半年债券市场各种收益率曲线大幅向上倾斜,其中中短评级债券产品收益率上升幅度超过高评级债券产品,收益率率曲线整体向上倾斜。本基金上半年对于利率产品和高等级债券进行了波段操作,并用债券资产置换了组合中到期债券,同时增加了对权益资产的投资。  
 4.4.2 报告期内基金的投资表现  
 截止本报告期末,本基金份额净值为1.032元,本报告期份额净值增长率为3.1%,同期业绩比较基准收益率为2.49%。本期内基金净值增长率好于基准,主要受益于组合超额了收益率较高的信用产品。  
 4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的重要展望  
 虽然统计局公布的2季度GDP数据验证了我们前期关于中国经济增长环比低位有较大可能出现在1季度的判断,但本轮经济周期中国经济调整的时间和复杂程度仍超出我们的预期。展望2012年下半年,随着近期以来实施的稳增长政策逐步发生效用,投资和消费将比增速逐步低位企稳并逐步回升,通胀压力进一步缓解,货币政策将更为宽松。由于债券市场对央行降息预期的已经较为充分,我们对债券市场的态度偏向中性,我们将继续优选高信用等级债券,在收益和风险之间做出较好的平衡;对于政策宽松幅度不及预期,2季度股市场波动幅度有超预期,而预期将在2季度进一步的调整,我们对股市保持中性偏乐观的态度。我们将和积极股票投资组合的构建,在对盈利前景改善的行业和个股进行配置的同时,将加大对能够穿越周期的成长股的配置力度。  
 4.6 管理人对外报告期末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包括风控与风险控制委员会、估值工作组及运营部,合规与风险控制委员会负责估值程序,估值工作组负责估值程序,运营部负责估值程序的日常执行,风控与风险控制委员会负责估值程序的日常监督,估值工作组负责估值程序的日常执行,运营部负责估值程序的日常执行。估值工作组负责估值程序的日常执行,运营部负责估值程序的日常执行,风控与风险控制委员会负责估值程序的日常监督,估值工作组负责估值程序的日常执行,运营部负责估值程序的日常执行。估值工作组负责估值程序的日常执行,运营部负责估值程序的日常执行,风控与风险控制委员会负责估值程序的日常监督,估值工作组负责估值程序的日常执行,运营部负责估值程序的日常执行。

**4.4.2 基金净值表现**

项目	本期	上期
一、收入	16,088,248.37	4,829.39
1.利息收入	9,596,232.46	-
其中:存款利息收入	4,991,178.08	-
债券利息收入	4,517,897.97	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,156.41	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	2,935,737.13	-
其中:股票投资收益	-749,589.64	-
债券投资收益	3,393,549.89	-
资产支持证券投资	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	291,776.88	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,871,770.82	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入	684,507.96	-
二、费用	3,738,163.68	-
1.管理人报酬	2,408,319.00	-
2.托管费	401,386.48	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	134,567.20	-
5.利息支出	596,825.22	-
其中:卖出回购金融资产支出	596,825.22	-
6.其他费用	197,065.69	-
三、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-
四、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-

注:本基金于2011年12月20日合同生效,无上年度可比期间数据。  
 6.3 所有者权益 基金净值变动表  
 基金管理人:国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金  
 本报告期:2012年1月1日-2012年6月30日

项目	本期	上期
一、期初所有者权益(基金净值)	603,310.45	464,832,492.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-12,350,084.69	-
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购/赎回/转换/转入/转出/转入/转出/转入/转出)	-130,832,482.02	-2,251,933.59
其中:基金申购款	3,762,978.07	53,753.73
2.基金赎回款	-134,595,460.09	-2,305,669.32
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(红利/股息/利息/手续费)	10,701,461.55	-
五、期末所有者权益(基金净值)	333,396,700.11	464,832,492.58

**6.2 利润分配**  
 基金管理人:国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金  
 本报告期:2012年1月1日-2012年6月30日

项目	本期	上期
一、收入	16,088,248.37	4,829.39
1.利息收入	9,596,232.46	-
其中:存款利息收入	4,991,178.08	-
债券利息收入	4,517,897.97	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,156.41	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	2,935,737.13	-
其中:股票投资收益	-749,589.64	-
债券投资收益	3,393,549.89	-
资产支持证券投资	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	291,776.88	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,871,770.82	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入	684,507.96	-
二、费用	3,738,163.68	-
1.管理人报酬	2,408,319.00	-
2.托管费	401,386.48	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	134,567.20	-
5.利息支出	596,825.22	-
其中:卖出回购金融资产支出	596,825.22	-
6.其他费用	197,065.69	-
三、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-
四、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-

注:本基金于2011年12月20日合同生效,无上年度可比期间数据。  
 6.3 所有者权益 基金净值变动表  
 基金管理人:国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金  
 本报告期:2012年1月1日-2012年6月30日

项目	本期	上期
一、期初所有者权益(基金净值)	603,310.45	464,832,492.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-12,350,084.69	-
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购/赎回/转换/转入/转出/转入/转出)	-130,832,482.02	-2,251,933.59
其中:基金申购款	3,762,978.07	53,753.73
2.基金赎回款	-134,595,460.09	-2,305,669.32
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(红利/股息/利息/手续费)	10,701,461.55	-
五、期末所有者权益(基金净值)	333,396,700.11	464,832,492.58

**6.4 基金管理人报告**

**6.4.1 基金基本情况**

国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会批准,由国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“国投瑞银”)发起,并经中国证监会核准,于2011年12月20日正式成立,注册地为上海。本基金为保本混合型证券投资基金,基金合同期限为不定期,首次公开发售募集规模为人民币共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第464号验资报告予以验证。经中国证监会备案,国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金净值为464,229,182.13份基金份额,其中认购基金份额共68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会批准,由国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“国投瑞银”)发起,并经中国证监会核准,于2011年12月20日正式成立,注册地为上海。本基金为保本混合型证券投资基金,基金合同期限为不定期,首次公开发售募集规模为人民币共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第464号验资报告予以验证。经中国证监会备案,国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金净值为464,229,182.13份基金份额,其中认购基金份额共68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

**6.4.2 基金净值表现**

项目	本期	上期
一、收入	16,088,248.37	4,829.39
1.利息收入	9,596,232.46	-
其中:存款利息收入	4,991,178.08	-
债券利息收入	4,517,897.97	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,156.41	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	2,935,737.13	-
其中:股票投资收益	-749,589.64	-
债券投资收益	3,393,549.89	-
资产支持证券投资	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	291,776.88	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,871,770.82	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入	684,507.96	-
二、费用	3,738,163.68	-
1.管理人报酬	2,408,319.00	-
2.托管费	401,386.48	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	134,567.20	-
5.利息支出	596,825.22	-
其中:卖出回购金融资产支出	596,825.22	-
6.其他费用	197,065.69	-
三、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-
四、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-

注:本基金于2011年12月20日合同生效,无上年度可比期间数据。  
 6.3 所有者权益 基金净值变动表  
 基金管理人:国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金  
 本报告期:2012年1月1日-2012年6月30日

项目	本期	上期
一、期初所有者权益(基金净值)	603,310.45	464,832,492.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-12,350,084.69	-
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购/赎回/转换/转入/转出/转入/转出)	-130,832,482.02	-2,251,933.59
其中:基金申购款	3,762,978.07	53,753.73
2.基金赎回款	-134,595,460.09	-2,305,669.32
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(红利/股息/利息/手续费)	10,701,461.55	-
五、期末所有者权益(基金净值)	333,396,700.11	464,832,492.58

**6.4.3 基金管理人报告**

**6.4.3.1 基金基本情况**

国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会批准,由国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“国投瑞银”)发起,并经中国证监会核准,于2011年12月20日正式成立,注册地为上海。本基金为保本混合型证券投资基金,基金合同期限为不定期,首次公开发售募集规模为人民币共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第464号验资报告予以验证。经中国证监会备案,国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金净值为464,229,182.13份基金份额,其中认购基金份额共68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会批准,由国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“国投瑞银”)发起,并经中国证监会核准,于2011年12月20日正式成立,注册地为上海。本基金为保本混合型证券投资基金,基金合同期限为不定期,首次公开发售募集规模为人民币共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第464号验资报告予以验证。经中国证监会备案,国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金净值为464,229,182.13份基金份额,其中认购基金份额共68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

**6.4.3.2 基金净值表现**

项目	本期	上期
一、收入	16,088,248.37	4,829.39
1.利息收入	9,596,232.46	-
其中:存款利息收入	4,991,178.08	-
债券利息收入	4,517,897.97	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,156.41	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	2,935,737.13	-
其中:股票投资收益	-749,589.64	-
债券投资收益	3,393,549.89	-
资产支持证券投资	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	291,776.88	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,871,770.82	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入	684,507.96	-
二、费用	3,738,163.68	-
1.管理人报酬	2,408,319.00	-
2.托管费	401,386.48	-
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	134,567.20	-
5.利息支出	596,825.22	-
其中:卖出回购金融资产支出	596,825.22	-
6.其他费用	197,065.69	-
三、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-
四、净利润(亏损以“-”号填列)	12,350,084.69	-

注:本基金于2011年12月20日合同生效,无上年度可比期间数据。  
 6.3 所有者权益 基金净值变动表  
 基金管理人:国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金  
 本报告期:2012年1月1日-2012年6月30日

项目	本期	上期
一、期初所有者权益(基金净值)	603,310.45	464,832,492.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-12,350,084.69	-
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(本期申购/赎回/转换/转入/转出/转入/转出)	-130,832,482.02	-2,251,933.59
其中:基金申购款	3,762,978.07	53,753.73
2.基金赎回款	-134,595,460.09	-2,305,669.32
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(红利/股息/利息/手续费)	10,701,461.55	-
五、期末所有者权益(基金净值)	333,396,700.11	464,832,492.58

**6.4.3.3 基金管理人报告**

**6.4.3.3.1 基金基本情况**

国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会批准,由国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“国投瑞银”)发起,并经中国证监会核准,于2011年12月20日正式成立,注册地为上海。本基金为保本混合型证券投资基金,基金合同期限为不定期,首次公开发售募集规模为人民币共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第464号验资报告予以验证。经中国证监会备案,国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金净值为464,229,182.13份基金份额,其中认购基金份额共68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会批准,由国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“国投瑞银”)发起,并经中国证监会核准,于2011年12月20日正式成立,注册地为上海。本基金为保本混合型证券投资基金,基金合同期限为不定期,首次公开发售募集规模为人民币共募集464,160,314.16元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第464号验资报告予以验证。经中国证监会备案,国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金于2011年12月20日正式生效,基金合同生效日的基金净值为464,229,182.13份基金份额,其中认购基金份额共68,867.97份基金份额。本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

**6.4.3.3.2 基金净值表现**

项目	本期	上期
一、收入	16,088,248.37	4,829.39
1.利息收入	9,596,232.46	-
其中:存款利息收入	4,991,178.08	-
债券利息收入	4,517,897.97	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,156.41	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	2,935,737.13	-
其中:股票投资收益	-749,589.64	-
债券投资收益	3,393,549.89	-
资产支持		