国投瑞银货币市场基金招募说明书摘要（2012年8月更新）

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

【重要提示】

国投瑞银货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2008年12月18日证监许可【2008】1423号文核准募集。本基金基金合同于2009年1月19日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金投资于货币市场工具，包括现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单、债券回购、央行票据以及剩余期限在397天以内（含397天）的债券及资产支持证券等。

投资者购买货币市场基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人管理的其他基金的过往业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日期为2012年7月19日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2012年6月30日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司于2012年8月14日对本招募说明书（2012年8月更新）进行了复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国投瑞银基金管理有限公司

英文名称：UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD

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

设立日期：2002年6月13日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】25号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：杨曼

联系电话：（0755）83575992

传　　真：（0755）82904048

股权结构：

股东名称	持股比例
国投信托有限公司	51%
瑞士银行股份有限公司（UBS AG）	49%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

钱蒙先生，董事长，中国籍，硕士，现任国家开发投资公司党组成员、副总裁、国投信托有限公司董事长。曾任国家开发投资公司总裁助理，中国包装总公司党组书记、总经理，国投财务有限公司董事长，国投资产管理公司总经理，安徽省六安市市委副书记，兴业基金管理有限公司董事，国家开发投资公司金融投资部总经理、经营部主任，国投机轻有限公司副总经理，国家开发投资公司机电轻纺业务部业务经理，国家机电轻纺投资公司工程师、副处长，国家计委干部、主任科员。

凌新源先生，董事，中国籍，硕士，高级经济师。现任瑞士银行（香港）环球资产管理公司董事总经理，中国区主席。曾任华夏基金管理有限公司董事长，北京证券有限公司董事长，华夏证券有限公司执行副总裁，中国钢铁工贸集团公司总裁助理，中国冶金进出口总公司总裁助理，北京国际信托投资公司业务部副经理。

王彬女士，董事，中国籍，硕士，高级经济师。现任国投信托有限公司副总经理兼董事会秘书。曾任国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书，国投信托有限公司资产管理部经理，北京国际电力开发投资公司、北京京能热电股份有限公司董事会秘书。

董日成先生，董事，中国香港籍，英国sheffield大学学士，现任瑞银环球资产管理公司中国区董事总经理。曾任瑞银环球资产管理公司中国区业务经理、执行董事，瑞银环球资产管理对冲基金亚太区首席营运官，瑞银环球资产管理台湾总经理，香港瑞银财富管理部门主管，国投瑞银基金管理有限公司的代总经理和首席营运官，美林投资经理人公司亚太地区首席营运官，美国国际集团亚太地区的金融及营运领域担任多个重要职务等。

李哲平先生，独立董事，中国籍，金融学硕士，现任当代金融家杂志社主编，中信银行独立董事、中航证券有限公司独立董事。曾任统信资产评估公司董事长、中国证券报理论版主编、中国金融培训中心助教。

史克通先生，独立董事，中国籍，法学学士，现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、律师，主要从事公司经常性业务及IPO、上市公司再融资及重大重组、证券投资基金及私募基金的设立、投资等业务；兼任中国忠旺控股有限公司独立董事。曾任职于山东鲁中律师事务所、北京市京都律师事务所。

龙海先生，独立董事，中国籍，硕士。现任北京海问投资咨询有限公司董事长、中央财经大学会计系副教授，兼任庆铃汽车股份有限公司和北辰实业股份有限公司独立董事。曾任华夏基金管理有限公司独立董事，曾在毕马威国际会计组约分部担任审计和财务分析工作。

2、监事会成员

叶锦华先生，监事长，中国香港籍，澳大利亚University of Technology，Western Australia学士，现任瑞银环球资产管理公司亚太区财务总监、董事总经理。曾任瑞银环球资产管理财务部执行董事、财务总监，并曾在港基银行和恒生银行等机构担任重要职务。

展飞先生，监事，中国籍，硕士，现任国投信托有限公司固有业务总部负责人。曾任国家开发投资公司战略发展部一级项目经理助理，国投信托有限公司信托资产运营部和信托资产管理部项目经理。

黄珍玖女士，监事，中国籍，硕士，经济师，现任本公司监察稽核部总监。曾任中融基金管理有限公司董事会秘书兼监察稽核部总监，河北证券有限责任公司深圳营业部副总经理，中国旅游信托投资有限公司深圳证券营业部总经理，建行辽宁省信托投资公司深圳证券营业部副总经理等。

3、公司高级管理人员及督察长

尚健先生，总经理，中国籍，美国康涅狄格大学金融学博士。曾任中国证监会基金部副处长，上海证券交易所发展战略委员会副总监，华安基金管理有限公司副总经理，银华基金管理有限公司总经理。

刘纯亮先生，副总经理，中国籍，经济学学士，中国注册会计师协会和特许公认会计师公会（ACCA）会员。曾任北京建工集团总公司会计，柏德家（BDO）关黄陈方国际会计师行会计师、中国证券监督管理委员会稽查员，博时基金管理有限公司监察法律部负责人、督察长。

盛斌先生，副总经理，中国籍，美国哥伦比亚大学国际关系学硕士。曾任国信证券北京投行部项目负责人、万家基金管理有限公司金融工程部总监、总经理助理兼市场总监。

路博先生，副总经理，中国籍，学士，会计师。曾任北京华讯通信发展总公司财务中心会计、主管会计，国投建化实业公司项目部、开发部、贸易部、计财部业务主管及会计主管，国家开发投资公司计划财务部资金处业务主管，国投信托有限公司财务部、资产管理部、综合管理部负责人。

包爱丽女士，督察长，中国籍，美国哥伦比亚大学硕士。曾任贝莱德资产管理有限公司资产管理核算部、共同基金部业务主管，银华基金管理有限公司战略发展部总监，国投瑞银基金管理有限公司产品及业务拓展部总监、总经理助理。

4、本基金基金经理

李达夫先生，中国籍，中山大学数量经济学硕士。6年证券从业经验，美国投资管理研究协会（CFA Institute）和全球风险协会（GARP）会员，拥有特许金融分析师（CFA）和金融风险管理师（FRM）资格。曾任职于东莞市农村商业银行，从事债券交易、研究工作。2008年4月加入国投瑞银基金管理有限公司，先后任职于交易部、基金投资部。2011年6月30日起任国投瑞银货币市场基金基金经理。

本基金历任基金经理：

韩海平先生，2009年1月19日至2012年2月14。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

①投资决策委员会主席：尚健先生，总经理

②投资决策委员会成员：

徐炜哲先生：基金投资部副总监，基金经理

韩海平先生：固定收益组副总监，基金经理

刘新勇先生：总经理助理兼专户投资部总监，投资经理

陈翔凯先生：专户投资部副总监，投资经理

邓跃辉先生：专户投资部副总监，投资经理

刘杰文先生：研究部总监

③公司督察长列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况：

截至2012年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工146人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称

（三）基金托管业务经营情况：

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年6月，中国工商银行共托管证券投资基金282只，其中封闭式7只，开放式245只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的31项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：国投瑞银基金管理有限公司直销中心

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）83575993　83575992

传真：（0755）82904048　82904007

联系人：曹丽丽、杨曼

客服电话：400-880-6868

网站：www.ubssdic.com

2、代销机构

①中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

传真：010-66107914

联系人：陶仲伟

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

②中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

办公地址：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

联系人：客户服务中心

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

③中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：王琳

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

④交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹熠

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

⑤中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号

法定代表人：唐双宁

电话：010-63636150

传真：010-63636157

联系人：薛军丽

客服电话：95595

公司网站：www.cebbank.com

⑥招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓柳鹏

客服电话：95555

公司网站：www.cmbchina.com

⑦中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客服电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

⑧平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路5047号深深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路5047号深深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：0755-22166212

传真：0755-82080406

联系人：周晓霞

客服电话：95511-3955501

公司网站：www.sdb.com.cn、www.pingan.com

⑨中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波

传真：010-85109219

联系人：客服中心

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

⑩华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号（100005）

法定代表人：吴建

电话：010-85238680

传真：010-85238680

联系人：马旭

客服电话：95577

公司网站：www.hxb.com.cn

⑪中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

电话：010-65558888

传真：010-65550827

联系人：丰靖

客服电话：95558

公司网站：http://bank.ecitic.com

⑫上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

⑬北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

电话：010-66223587

传真：010-66226045

联系人：谢小华

客服电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

⑭上海银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：宁黎明

电话：（021）68475888

传真：（021）68476111

联系人：张萍

客服电话：（021）962888

公司网站：www.bankofshanghai.com

⑮江苏吴江农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省吴江市中山南路1777号

办公地址：江苏省吴江市中山南路1777号

法定代表人：陆玉根

电话：0512-63969960

传真：0512-63969962

联系人：傅婉群

客服电话：0512-96068、400-8696-068

公司网站：www.wjrcb.com

⑯中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568888

传真：010-66568990

联系人：田薇

客服电话：400-888-8888

公司网站：www.chinastock.com.cn

⑰国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

公司网站：www.gtja.com

⑱国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

公司网站：www.guosen.com.cn

⑲申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：曹晔

客服电话：95523或4008895523

公司网站：www.sywg.com

⑳招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82960141

联系人：林生迎

客服电话：95565、4008888111

公司网站：www.newone.com.cn

㉑广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

电话：95575或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

公司网站：http://www.gf.com.cn

㉒中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

㉓申银国际证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

联系人：李春芳

客服电话：0755-33680000、400-6666-888

公司网站：www.cgws.com

㉔齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网站：www.qlzq.com.cn

㉕渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

客服电话：400-651-5988

公司网站：http://www.bhzq.com

㉖山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

客服电话：400-666-1618

公司网站：www.i618.com.cn

㉗东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

客服电话：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

㉘广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

法定代表人：刘东

电话：020-8836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

客服电话：020-961303

公司网站：www.gzs.com.cn

㉙中国中投证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

客服电话：400-600-8008

公司网站：www.china-invs.cn

㉚东莞证券有限责任公司

住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：张运水

电话：0769-22116557

传真：0769-22119423

联系人：张巧玲

客服电话：0769-961130

公司网站：www.dgzq.com.cn

㉛东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼、19楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼、19楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：李涛

客服电话：400-888-8588

公司网站：www.longone.com.cn

㉜国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

电话：010-84183333

传真：010-84183311

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

公司网站：www.guodu.com

㉝国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：028-86690126

传真：028-86690126

联系人：金喆

客服电话：4006-600109；95105111（四川省内按打）

公司网站：www.gjzq.com.cn

㉞上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

电话：0755-84588888

传真：0755-84865560

联系人：陈忠

公司网站：www.cs.ecitic.com

㉟华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3层

法定代表人：丁之锁

电话：010-58568040

传真：010-58568062

联系人：陶颖

客服电话：010-58568118

公司网站：www.hrsec.com.cn

㊱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：石保上

电话：0371-65585670

传真：0371-65585665

联系人：程月艳、耿铭

客服电话：967218、400-813-9666

公司网站：www.ccnew.com

㊲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：卢金文

客服电话：0592-5163588

公司网站：www.xmzq.cn

㊳爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路758号博爱大厦20-25楼

办公地址：上海市南京西路758号博爱大厦20-25楼

法定代表人：郭林

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：陈敏

客服电话：021-63340678

公司网站：www.ajzq.com

㊴世纪证券有限责任公司

住所：深圳深南大道7088号招商银行大厦40-42层

办公地址：深圳深南大道7088号招商银行大厦40-42层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：万文

客服电话：0755-83199509

公司网站：www.csco.com.cn

㊵华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290834

传真：025-51863323

联系人：程高峰

客服电话：95597

公司网站：www.htsc.com.cn

㊶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：翟建强

电话：0311-66006403

传真：0311-66006201

联系人：胡士光

客服电话：4006128888

公司网址：www.S10000.com

㊷东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096709

传真：0431-85096795

联系人：潘锴

客服电话：400-600-0686

公司网站：www.nesc.cn

㊸归信证券有限责任公司

住所：呼和浩特市新城区锡林南路18号

办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人：孔佑杰

电话：010-88086830

传真：010-66412537

联系人：陈韦杉、朱晓光

客服电话：010-88086830

公司网站：www.rczq.com.cn

㊹天津证券有限责任公司

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：岳献春

电话：010-85127999

传真：010-85127917

联系人：赵明

客户服务电话：400-619-8888

网址：www.mszq.com

㊺东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路181号

办公地址：苏州工业园区翠园路181号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：0512-33396288

网址：www.dwzq.com.cn

㊻招商证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市镇星路13　号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3　楼

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83709350

传真：0755-83700205

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

㊼长城证券证券销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦1、1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、1单元

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

联系人：张玉静

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn及　www.jjmmw.com

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）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、单峰

联系人：单峰

四、基金的名称

本基金名称：国投瑞银货币市场基金。

五、基金的类型

本基金类型：货币市场基金。基金运作方式：契约型、开放式。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为：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。

七、基金的投资方向

本基金投资于以下金融工具：

1、现金；

2、通知存款；

3、短期融资券；

4、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单；

5、剩余期限在397天以内（含397天）的债券；

6、期限在1年以内（含1年）的债券回购；

7、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；

8、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券；

9、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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。

1、资产配置策略

①整体配置策略

根据对利率水平、GDP、CPI、PPI、货币供应量、国际利率水平、汇率等宏观经济指标和宏观调控政策的分析，决定基金投资组合的剩余期限及期限分布结构。

②类别资产配置策略

根据不同类别资产的收益率水平（含剩余期限到期收益率、利息支付方式和再投资便利性），并结合各类资产的流动性特征（如均成交量、交易方式、市场流量）和风险特征（信用等级、波动性），决定各类资产的配置比例和期限匹配量。

③期细资产配置策略

根据明细资产的信用等级、剩余期限和流动性（以均成交量和平均每笔成交间隔时间）进行初步筛选；根据明细资产的收益率与剩余期限的结构合理性，决定其投资价值，进行再次筛选；根据明细资产的到期收益率波动性与可投资量（流通量、日均成交量与冲击成本估算），决定具体投资量。

2、交易策略

本基金通过研判货币市场利率趋势、货币供求关系和各短期金融工具相对收益期限结构状况，在有效控制流动性风险的基础上，贯彻实施以下投资策略：

①货币市场利率预期策略

通过宏观经济形势、财政货币政策和短期资金供求状况的深入分析，对短期利率走势进行合理预估，并据此实施以调整基金组合平均到期期限为主的资产配置策略。当预期短期利率呈下降趋势时，侧重配置期限较长的短期金融工具；反之，则侧重配置期限较短的金融工具。

②资产动态优化配置策略

在对利率趋势、各短期金融工具的市场规模、流动性以及与其期限相对应的预期收益率进行深入研判的基础上，在流动性要求约束下，以收益极大化为目标，建立动态规划模型，对类属资产配置比例以及类属资产内部不同期限结构品种的配置比例进行优化。

③套利策略

不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素差异化影响而出现定价差异，从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，适度进行跨市场或跨品种套利操作，提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利，期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作（跨期限套利）。

④峰值策略

把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线机会。如新股发行期间、年末资金回笼时期的季节效应等短期资金供求失衡，导致回购利率突增等。

⑤现金流均衡管理策略

通过对基金申购、赎回现金流的预测，在投资组合的构建中，对各投资品种的剩余期限搭配进行合理布局。例如，为满足日常的较稳定的现金流变现需要，可采纳相同品种（如回购等）的滚动投资策略，即采用均分资金量、持续滚动投资的方法，使得该品种自然到期兑现的现金流在时间上均匀化。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：同期7天通知存款利率（税后），即①×利息税率（同期7天通知存款利率。

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。

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比较基准时，本基金可以在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

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2012年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	3,062,602,696.56	47.34
	其中：债券	3,062,602,696.56	47.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	3,315,617,780.06	51.25
4	其他资产	90,717,072.61	1.40
5	合计	6,468,937,549.23	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	6.99	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	916,997,882.50	16.53
	其中：买断式回购融资	-	-

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。

3、基金投资组合平均剩余期限

①报告期内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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	92

注：本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

②报告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	16.80	16.53
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.82	-
2	30天（含）-60天	18.99	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.73	-
3	60天（含）-90天	28.78	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.82	-
4	90天（含）-180天	26.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	24.04	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	114.96	16.53

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	895,968,053.29	16.15
	其中：政策性金融债	895,968,053.29	16.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,166,634,643.27	39.05
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,062,602,696.56	55.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	464,181,055.87	8.37

5、报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	070419	07农发19	2,700,000	271,276,270.68	4.89
2	110206	11国开06	2,400,000	242,074,745.73	4.36
3	041258005	12中铝业CP001	1,600,000	160,562,875.98	2.89
4	070219	07国开19	1,600,000	160,510,726.74	2.89
5	041253004	12武钢CP001	1,400,000	140,451,639.06	2.53
6	041160016	11苏国信CP002	1,300,000	130,372,203.84	2.35
7	100209	10国开09	1,000,000	101,163,045.72	1.82
8	100236	10国开36	1,000,000	100,713,920.69	1.82
9	041261011	12中普天CP001	1,000,000	100,650,317.95	1.81
10	071201001	12招商CP001	1,000,000	99,983,223.34	1.80

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	24
报告期内偏离度的最高值	0.4218%
报告期内偏离度的最低值	0.0755%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2157%

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。

8、投资组合报告附注

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。

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。

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。

④其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	129,464.29
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	78,656,887.56
4	应收申购款	11,930,720.76
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	90,717,072.61

⑤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。

十二、基金的业绩

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应仔细阅读本