

国投瑞银货币市场基金2010年年度报告

2010年12月31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3月25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3月24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。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§ 7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告.....	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 债券回购融资情况.....	40
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.5 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.....	42
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	42
8.7 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.....	43
8.8 投资组合报告附注.....	43
§ 9 基金份额持有人信息.....	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	44

§ 10 开放式基金份额变动.....	44
§ 11 重大事件揭示.....	45
11.1 基金份额持有人大会决议.....	45
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4 基金投资策略的改变.....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
11.9 其他重大事件.....	46
§ 12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银货币市场基金	
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1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	3,627,515,235.50	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
下属分级基金的交易代码	121011	128011
报告期末下属分级基金的份 额总额	150,232,587.29	3,477,282,648.21

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
	联系电话	400-880-6868
	电子邮箱	service@ubssdic.com
客户服务电话	400-880-6868	95588
传真	0755-82904048	010-66105798
注册地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518035	100140
法定代表人	钱蒙	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年		2009年1月19日-2009年12月31日	
	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
本期已实现收益	2,101,532.05	20,092,484.81	2,157,598.40	10,036,732.72
本期利润	2,101,532.05	20,092,484.81	2,157,598.40	10,036,732.72
本期净值收益率	1.7642%	2.0099%	0.9336%	1.1647%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末		2009年末	
期末基金资产净值	150,232,587.29	3,477,282,648.21	360,051,998.02	5,889,054,467.78
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2010年末		2009年末	
累计净值收益率	2.7143%	3.1980%	0.9336%	1.1647%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金根据每日基金收益情况以每万份基金收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付。

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

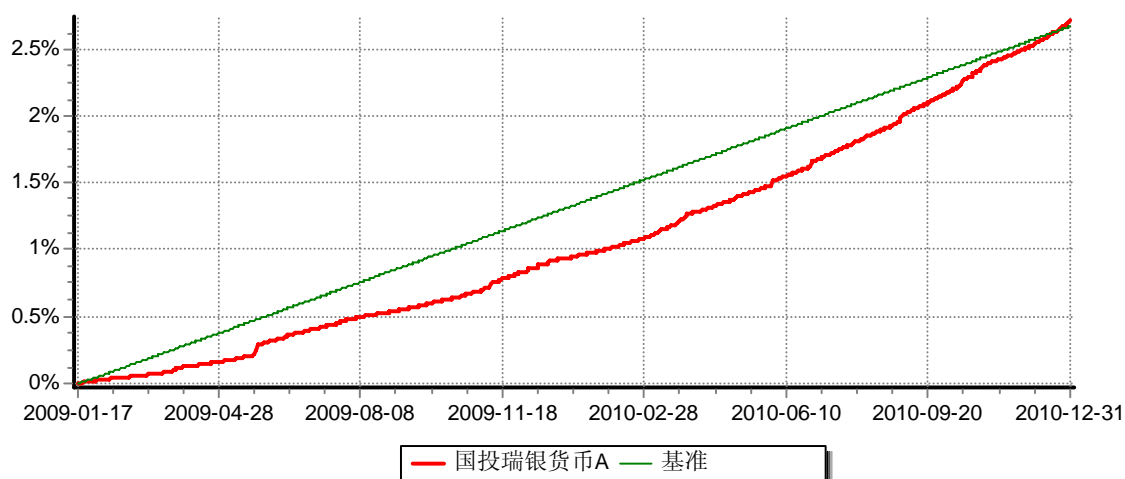
阶段 (国投瑞银货币A)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5494%	0.0041%	0.3456%	0.0000%	0.2038%	0.0041%
过去六个月	1.0358%	0.0036%	0.6924%	0.0000%	0.3434%	0.0036%
过去一年	1.7642%	0.0039%	1.3781%	0.0000%	0.3861%	0.0039%

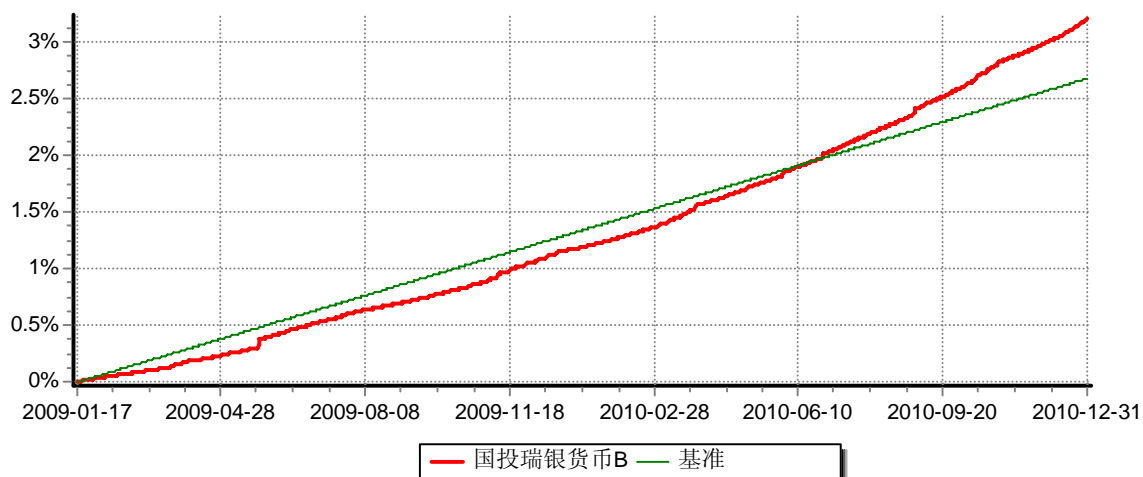
自基金合同生效日起至今	2.7143%	0.0040%	2.7059%	0.0000%	0.0084%	0.0040%
-------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

阶段 (国投瑞银货币B)	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
过去三个月	0.6102%	0.0041%	0.3456%	0.0000%	0.2646%	0.0041%
过去六个月	1.1581%	0.0036%	0.6924%	0.0000%	0.4657%	0.0036%
过去一年	2.0099%	0.0039%	1.3781%	0.0000%	0.6318%	0.0039%
自基金合同生效日起至今	3.1980%	0.0040%	2.7059%	0.0000%	0.4921%	0.0040%

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。故本基金本报告期以税前七天通知存款利率（实际为1.35%）为业绩比较基准。

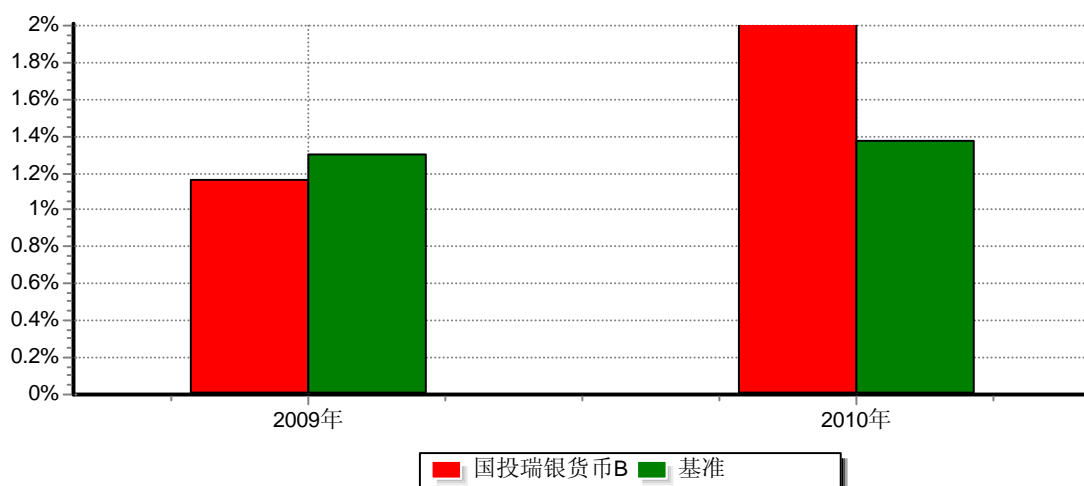
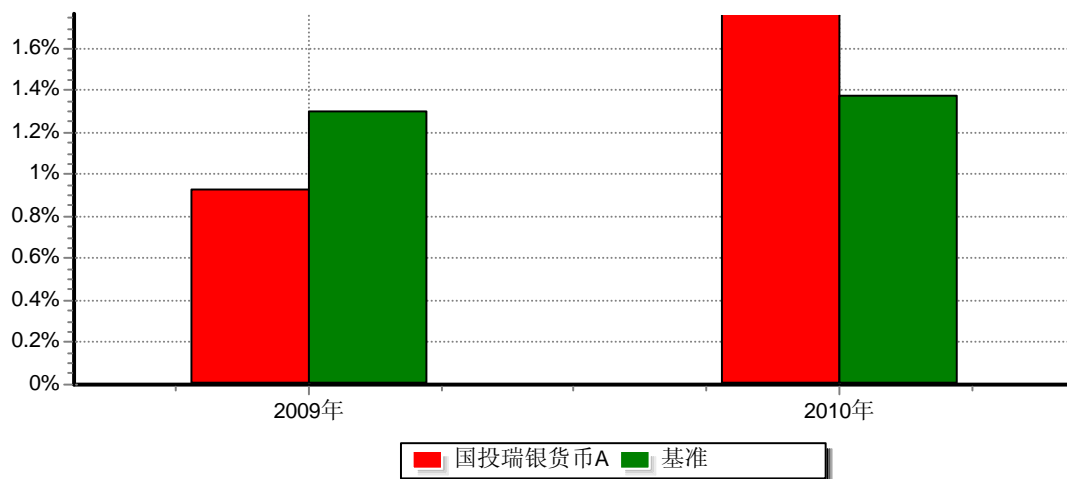
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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17.40%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例14.43%，符合基金合同相关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2009年1月19日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (国投瑞银货币A)	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2010年	2,101,532.05	—		2,101,532.05	
2009年1月19日至 2009年12月31日	2,157,598.40	—		2,157,598.40	
合计	4,259,130.45	—	—	4,259,130.45	
年度 (国投瑞银货币B)	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2010年	20,092,484.81			20,092,484.81	
2009年1月19日至 2009年12月31日	10,036,732.72			10,036,732.72	
合计	30,129,217.53	—	—	30,129,217.53	

§ 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160人，其中95人具有硕士或博士学位。截止2010年12月底，公司管理14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	2009年1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GARP会员，金

	副总监			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基金经理。
--	-----	--	--	--

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合规守信情况的说明

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，本基金未发现可能的异常交易行为。

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

2010年上半年，货币市场资金较为充裕，央行公开市场操作保持净投放，7天回购利率在1.6%附近宽幅震荡。下半年，央行货币政策有所调整，先后多次上调存款准备金率以及存贷款利率；此外市场资金面还受到银行机构季末流动性备付影响，回购利率大幅上升，7天回购震荡上行至6.5%附近。报告期内，本基金主要增加浮息债和短融的配置，适当延长了组合久期。

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1.76%，B级份额净值增长率为2.01%，同期业绩比较基准收益率为1.38%。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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计随着货币政策转为稳健以及受购置税等消费刺激政策到期因素影响，2011年一季度经济增长将有所放缓；同时受冬季恶劣天气情况影响，一季度CPI上行的压力仍然较大，央行可能再次加息。随着市场资金面有所缓解，此前经历大幅调整的短期品种收益有望暂时下行，但一年期央票发行量保持低位，且一二级收益倒挂严重，显示央票发行利率上升压力依然较大。基于对宏观经济和债券市场的判断，本基金将适当缩短组合剩余期限，减少对信用债券投资，增加定期存款投资比例。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人高度重视风险控制，充分发挥监察稽核工作的作用，提高监察稽核工作的有效性，为公司业务规范运作提供保证和支持，确保公司的业务运作能切实贯彻执行法律、法规和公司内控制度。本基金管理人充分意识到投资业务规范化的重要性，应用国际先进的风险管理系统，建立和完善风险管理体系，本年度重点安排对投资管理的业务流程、公平交易管理以及研究支持、投资决策、交易执行、清算TA以及信息管理等核心业务的合规性每季度进行监察，并对其它相关业务也安排定期检查，不漏死角。

本基金管理人对公司投资管理等重要业务实行事前、事中和事后全程监督，多环节控制：

事前审查审核：充分利用信息系统，将有关法律法规、基金合同和公司规定的各种投资禁止、投资限制和量化监控指标在交易系统中进行阈值设置，基金投资如果超出限制，系统将拒绝执行指令并及时报警。基金合同、招募说明书（更新）、基金定期报告、临时报告及基金宣传材料等对外披露信息文稿，在上报核准和对外发布前必须经过监察稽核部、信息披露负责人和督察长的合法合规性审查。

事中实时监控：交易部设立实时监控岗位，按照投资决策委员会、监察稽核部等确定的控制要求，对基金经理的投资指令进行执行前的审查，发现违法违规和越权行为，有权拒绝执行并及时报告监察稽核部、督察长。监察稽核部也对基金投资的关键环节实行实时监控。

事后检查督促：监察稽核部采取现场与非现场稽核结合，并以现场稽核为主的方式对基金投资进行检查。非现场稽核主要是通过计算机系统观察每日的交易情况，从中分析是否有违规交易行为。现场稽核主要是对公司各业务环节进行定期的例行检查和专项检查，并对主要业务部门及重点业务环节进行不定期的突击检查，发现问题及时报告并监督整改。

4.7 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。

4.8 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2,101,532.05元，国投瑞银货币B本期已实现收益为20,092,484.81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

2010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、利润分配等情况的说明

2010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2010年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2011)第20410号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国投瑞银货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的国投瑞银货币市场基金的财务报表，包括2010年12月31日的资产负债表、2010年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是国投瑞银货币市场基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： <ol style="list-style-type: none"> (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报； (2) 选择和运用恰当的会计政策； (3) 作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报

	<p>表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了国投瑞银货币市场基金2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和净值变动情况。</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	
<p>薛 竞</p>	
<p>金 毅</p>	
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所有限公司</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国 上海市</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2011-03-22</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银货币市场基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,192,464,651.35	813,749,138.61
结算备付金		1,304,545.45	4,523,809.52
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	631,106,346.12	719,073,934.03
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		631,106,346.12	719,073,934.03
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,055,404,189.70	2,717,252,212.73
应收证券清算款		—	1,674,279,506.11
应收利息	7.4.7.5	5,744,190.11	3,110,774.49
应收股利		—	—
应收申购款		57,251,969.62	318,065,688.16
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		3,943,275,892.35	6,250,055,063.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
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		14,384.06	109,535.91
应付管理人报酬		460,547.03	527,175.16
应付托管费		139,559.69	159,750.07
应付销售服务费		34,839.51	44,619.44
应付交易费用	7.4.7.7	16,663.05	11,495.58
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	94,663.51	96,021.69
负债合计		315,760,656.85	948,597.85
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,627,515,235.50	6,249,106,465.80
未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		3,627,515,235.50	6,249,106,465.80
负债和所有者权益总计		3,943,275,892.35	6,250,055,063.65

注：1. 报告截止日 2010 年 12 月 31 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 3,627,515,235.50 份，其中国投瑞银货币 A 150,232,587.29 份，国投瑞银货币 B 3,477,282,648.21 份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：国投瑞银货币市场基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010 年12月31日	上年度可比期间 2009年1月19日(基金 合同生效日)至2009 年12月31日
一、收入		28,580,666.50	18,639,317.70
1. 利息收入		25,846,778.45	15,608,391.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,540,763.13	762,994.71

债券利息收入		13,025,334.15	10,245,762.44
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		6,280,681.17	4,599,633.85
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,733,888.05	2,819,647.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	2,733,888.05	2,819,647.68
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	—	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	—	211,279.02
减：二、费用		6,386,649.64	6,444,986.58
1. 管理人报酬		4,075,737.80	3,959,905.25
2. 托管费		1,235,072.08	1,199,971.37
3. 销售服务费		423,208.29	810,670.02
4. 交易费用	7.4.7.18	—	—
5. 利息支出		201,386.97	46,631.39
其中：卖出回购金融资产支出		201,386.97	46,631.39
6. 其他费用	7.4.7.19	451,244.50	427,808.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,194,016.86	12,194,331.12
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,194,016.86	12,194,331.12

7.3 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：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	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）		22,194,016.86	22,194,016.86
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）	-2,621,591,230.30	—	-2,621,591,230.30
其中：1. 基金申购款	9,442,305,130.15	—	9,442,305,130.15
2. 基金赎回款	-12,063,896,360.45	—	-12,063,896,360.45
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）	—	-22,194,016.86	-22,194,016.86
五、期末所有者权益（基金净值）	3,627,515,235.50	—	3,627,515,235.50
项 目	上年度可比期间 2009年1月19日（基金合同生效日）至2009年12月31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）	3,832,962,892.61	—	3,832,962,892.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	12,194,331.12	12,194,331.12

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）	2,416,143,573.19	—	2,416,143,573.19
其中：1. 基金申购款	9,265,153,749.58	—	9,265,153,749.58
2. 基金赎回款	-6,849,010,176.39	—	-6,849,010,176.39
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）	—	-12,194,331.12	-12,194,331.12
五、期末所有者权益（基金净值）	6,249,106,465.80	—	6,249,106,465.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人

尚健

主管会计工作负责人

刘纯亮

会计机构负责人

冯伟

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国投瑞银货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1423号《关于核准国投瑞银货币市场基金募集的批复》核准,由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,832,846,202.83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(2009)第002号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银货币市场基金基金合同》于2009年1月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,832,962,892.61份基金份额,其中认购资金利息折合116,689.78份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额等级,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额等级。本基金设A级和B级两级基金份额,两级基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收

益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得互相转换。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《国投瑞银货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金,通知存款,短期融资券,一年以内的银行定期存款、大额存单,剩余期限在397天以内的债券,期限在一年以内的债券回购,期限在一年以内的中央银行票据,剩余期限在397天以内的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司于2011年3月22日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2009年1月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.5%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变

化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表内列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的国投瑞银货币A和国投瑞银货币B份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

本基金每日计算当日收益并全部分配结转至实收基金科目，不适用损益平准金会计政策。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额等级的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定

份额净值交易方式，每日计算当日收益并以红利再投资形式每日全部按份额面值1.00元分配结转至实收基金科目。每月集中宣告收益分配并将当月收益结转到基金份额持有人基金账户。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期未发生会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	372,464,651.35	813,749,138.61
定期存款	820,000,000.00	—
其中：存款期限1-3个月	820,000,000.00	—
其他存款	—	—
合计	1,192,464,651.35	813,749,138.61

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金本期及上年度可比期间发生定期存款提前支取，未造成利息损失。

7.4.7.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

项目		本期末2010年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	631,106,346.12	630,408,000.00	-698,346.12	-0.0193
	合计	631,106,346.12	630,408,000.00	-698,346.12	-0.0193
项目		上年度末2009年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	719,073,934.03	719,976,000.00	902,065.97	0.0144
	合计	719,073,934.03	719,976,000.00	902,065.97	0.0144

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；

偏离度=偏离金额÷摊余成本法确定的基金资产净值×100%。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	373,000,006.10	—
银行间市场	1,682,404,183.60	—
合计	2,055,404,189.70	—
项目	上年度末2009年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,291,800,000.00	—
银行间市场	1,425,452,212.73	—
合计	2,717,252,212.73	—

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2010年12月31日	上年度末2009年12月31日
应收活期存款利息	7,096.79	70,261.39
应收定期存款利息	1,186,690.62	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	456.60	1,583.30
应收债券利息	2,975,138.32	2,823,041.98
应收买入返售证券利息	1,565,881.73	215,887.82
应收申购款利息	8,926.05	—
其他	—	—
合计	5,744,190.11	3,110,774.49

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2010年12月31日	上年度末2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	16,663.05	11,495.58
合计	16,663.05	11,495.58

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2010年12月31日	上年度末2009年12月31日
预提费用	94,500.00	94,500.00
应付转换费	163.51	1,521.69
合计	94,663.51	96,021.69

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目(国投瑞银货币A)	本期2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	360,051,998.02	360,051,998.02
本期申购	1,422,998,841.86	1,422,998,841.86
本期赎回(以“-”号填列)	-1,632,818,252.59	-1,632,818,252.59
本期末	150,232,587.29	150,232,587.29
项目(国投瑞银货币B)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,889,054,467.78	5,889,054,467.78
本期申购	8,019,306,288.29	8,019,306,288.29
本期赎回(以“-”号填列)	-10,431,078,107.86	-10,431,078,107.86
本期末	3,477,282,648.21	3,477,282,648.21

注：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，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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (国投瑞银货币 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	2,101,532.05	-	2,101,532.05
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,101,532.05	-	-2,101,532.05
本期末	-	-	-

单位：人民币元

项目 (国投瑞银货币 B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	20,092,484.81	-	20,092,484.81
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-20,092,484.81	-	-20,092,484.81
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日
活期存款利息收入	465,142.38	538,736.48
定期存款利息收入	5,799,565.63	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	104,870.73	99,132.11
其他	171,184.39	125,126.12

合计	6,540,763.13	762,994.71
----	--------------	------------

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2010年1月1日至2010年 12月31日)	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同 生效日)至2009年12月31 日
卖出债券(债券到期兑付)成交总额	1,914,804,224.63	4,642,691,853.09
减:卖出债券(债券到期兑付)成本总额	1,892,560,665.67	4,628,558,565.70
减:应收利息总额	19,509,670.91	11,313,639.71
债券投资收益	2,733,888.05	2,819,647.68

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同 生效日)至2009年12月31 日
募集期间认购资金利息收入	—	211,279.02
合计	—	211,279.02

7.4.7.18 交易费用

本基金本期及上年度可比期间无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同生效日)至2009年12月31日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	300,000.00	290,000.00
银行划款手续费	43,244.50	30,408.55
债券托管账户维护费	18,000.00	17,400.00
合计	451,244.50	427,808.55

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金分别于2011年1月19日、2月21日、3月21日，将2010年12月20日至2011年1月18日、2011年1月19日至2011年2月20日、2011年2月21日至2011年3月20日期间收益折算成基金份额划入基金份额持有人账户。

7.4.9 关联方关系

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
国投信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同生 效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支 付的管理费	4,075,737.80	3,959,905.25
其中：支付销售机构的 客户维护费	333,838.88	626,445.50

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同生 效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支 付的托管费	1,235,072.08	1,199,971.37

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。

7.4.10.2.3 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 2010年1月1日至2010年12月31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
中国工商银行	127,503.23	4,198.88	131,702.11
国投瑞银基金管理有限公司	79,679.56	71,569.84	151,249.40

合计	207,182.79	75,768.72	282,951.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同生效日)至2009年12月31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
中国工商银行	484,144.78	5,201.71	489,346.49
国投瑞银基金管理有限公司	23,952.15	72,564.66	96,516.81
合计	508,096.93	77,766.37	585,863.30

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。

7.4.10.3 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

本期 2010年1月1日至2010年12月31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	-	20,174,629.98	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月19日(基金合同生效日)至2009年12月31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	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

本基金本期及上年度可比期间无关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月19日(基金合同生效

	日)至2009年12月31日			
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行 —活期存款	372,464,651.35	465,142.38	813,749,138.61	538,736.48

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国投瑞银货币A

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
2,101,532.05	—	—	2,101,532.05	

国投瑞银货币B

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
20,092,484.81	—	—	20,092,484.81	

注：本基金在本年度累计分配收益22,194,016.86元，以红利再投资方式结转入实收基金22,194,016.86元。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，定期银行存款存放在上海银行股份有限公司和兴业银行股份有限公司，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。其中，本期末本基金持有中央银行票据及政策性金融债合计311,013,351.68元属政府机构债，评级机构未评级（2009年12月31日：399,354,385.36元）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
A-1	320,092,994.44	319,719,548.67
合计	320,092,994.44	319,719,548.67

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末无长期信用评级债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的20%。

除卖出回购金融资产按余额计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人执行灵活的利率管理策略规避利率风险，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预

期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,192,464,651.35		—	—	—	—	1,192,464,651.35
结算备付金	1,304,545.45		—	—	—	—	1,304,545.45
交易性金融资产	99,854,808.20	211,158,543.48	320,092,994.44	—	—	—	631,106,346.12
买入返售金融资产	2,055,404,189.70		—	—	—	—	2,055,404,189.70
应收利息	—		—	—	—	5,744,190.11	5,744,190.11
应收申购款	500,000.00		—	—	—	56,751,969.62	57,251,969.62
资产总计	3,349,528,194.70	211,158,543.48	320,092,994.44	—	—	62,496,159.73	3,943,275,892.35
负债							
应付证券清算款	—		—	—	—	315,000,000.00	315,000,000.00
应付赎回款	—		—	—	—	14,384.06	14,384.06
应付管理人报酬	—		—	—	—	460,547.03	460,547.03
应付托管费	—		—	—	—	139,559.69	139,559.69
应付销售服务费	—		—	—	—	34,839.51	34,839.51
应付交易费用	—		—	—	—	16,663.05	16,663.05
其他负债	—		—	—	—	94,663.51	94,663.51
负债总计	—		—	—	—	315,760,656.85	315,760,656.85
利率敏感度缺口	3,349,528,194.70	211,158,543.48	320,092,994.44	—	—	-253,264,497.12	3,627,515,235.50
上年度末	1个月以内	1至3个月	3个月	1至5年	5年以上	不计息	合计

2009年12月31日			至1年				
资产							
银行存款	813,749,138.61		—	—	—	—	813,749,138.61
结算备付金	4,523,809.52		—	—	—	—	4,523,809.52
交易性金融资产	90,003,577.30	210,498,969.27	418,571,387.46	—	—	—	719,073,934.03
买入返售金融资产	2,717,252,212.73		—	—	—	—	2,717,252,212.73
应收证券清算款	—		—	—	—	1,674,279,506.11	1,674,279,506.11
应收利息	—		—	—	—	3,110,774.49	3,110,774.49
应收申购款	60,110,700.00		—	—	—	257,954,988.16	318,065,688.16
资产总计	3,685,639,438.16	210,498,969.27	418,571,387.46	—	—	1,935,345,268.76	6,250,055,063.65
负债							
应付赎回款	—		—	—	—	109,535.91	109,535.91
应付管理人报酬	—		—	—	—	527,175.16	527,175.16
应付托管费	—		—	—	—	159,750.07	159,750.07
应付销售服务费	—		—	—	—	44,619.44	44,619.44
应付交易费用	—		—	—	—	11,495.58	11,495.58
其他负债	—		—	—	—	96,021.69	96,021.69
负债总计	—		—	—	—	948,597.85	948,597.85
利率敏感度缺口	3,685,639,438.16	210,498,969.27	418,571,387.46	—	—	1,934,396,670.91	6,249,106,465.80

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
市场利率下降25个基点		上升约113	上升约141
市场利率上升25个基点		下降约113	下降约140

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为631,106,346.12元，无属于第一层级和第三层级的余额(2009年12月31日：第二层

级的余额为719,073,934.03元，无属于第一层级和第三层级的余额)。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	631,106,346.12	16.00
	其中：债券	631,106,346.12	16.00
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	2,055,404,189.70	52.12
	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	1,193,769,196.80	30.27
	其他各项资产	62,996,159.73	1.60
	合计	3,943,275,892.35	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.93	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
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

注：1、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。

2、本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过资产净值20%的情形。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	34
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

注：本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

8.3.2 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	85.43	8.68
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	8.27	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	4.45	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.45	—
4	90天(含)—180天	2.21	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	6.62	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	106.98	8.68

8.4 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	49,889,833.10	1.38
3	金融债券	261,123,518.58	7.20
	其中：政策性金融债	261,123,518.58	7.20
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	320,092,994.44	8.82
6	其他	—	—
7	合计	631,106,346.12	17.40
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	161,268,710.38	4.45

8.5 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	100221	10国开21	1,000,000	99,854,808.20	2.75
2	070211	07国开11	800,000	80,793,057.94	2.23
3	070219	07国开19	800,000	80,475,652.44	2.22
4	1001011	10央票11	500,000	49,889,833.10	1.38
5	1081228	10时代CP01	300,000	30,021,736.69	0.83
6	1081314	10白药CP01	300,000	30,000,543.76	0.83
7	1081327	10西王CP01	300,000	30,000,000.00	0.83
8	1081200	10云冶CP01	200,000	20,038,449.25	0.55
9	1081246	10晋能源CP01	200,000	20,028,716.39	0.55
10	1081374	10陕有色CP02	200,000	20,001,078.50	0.55

8.6 “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	1

报告期内偏离度的最高值	0.2608
报告期内偏离度的最低值	-0.1137
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1095

8.7 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

本基金本期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

8.8.4 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	5,744,190.11
4	应收申购款	57,251,969.62
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	62,996,159.73

8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

本基金本期末未投资托管行股票、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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
国投瑞银货币A	2,168	69,295.47	56,000,126.55	37.28%	94,232,460.74	62.72%
国投瑞银货币B	92	37,796,550.52	3,305,380,039.06	95.06%	171,902,609.15	4.94%
合计	2,260	1,605,095.24	3,361,380,165.61	92.66%	266,135,069.89	7.34%

9.2 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	国投瑞银货币A	15,981.46	0.01%
	国投瑞银货币B	-	-
	合计	15,981.46	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
基金合同生效日(2009年1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	360,051,998.02	5,889,054,467.78
本报告期期间基金总申购份额	1,422,998,841.86	8,019,306,288.29
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,632,818,252.59	10,431,078,107.86
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	150,232,587.29	3,477,282,648.21
-------------	----------------	------------------

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人无重大人事变动。

报告期内经证监会审批，晏秋生任资产托管人中国工商银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金连续提供审计服务2年。报告期内应支付给该事务所的报酬为90,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	13,983,900,000.00	95.01%	—	—	新增1个
华泰联合证券	1	315,000,000.00	2.14%	—	—	新增
平安证券	1	110,000,000.00	0.75%	—	—	新增

中银国际	1	80,000,000.00	0.54%	—	—	新增
国金证券	1	70,000,000.00	0.48%	—	—	
华融证券	1	59,000,000.00	0.40%	—	—	新增
中信证券	2	42,000,000.00	0.29%	—	—	新增
齐鲁证券	1	20,000,000.00	0.14%	—	—	新增
信达证券	1	20,000,000.00	0.14%	—	—	新增
东方证券	1	10,000,000.00	0.07%	—	—	新增
安信证券	3	8,000,000.00	0.05%	—	—	新增

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本报告期本基金未发生交易所债券和权证交易。

3、除上表备注列示新增交易单元外，本基金本报告期还新增中信建投证券3个交易单元，新增瑞银证券、银河证券和海通证券各2个交易单元，新增国信证券、申银万国、招商证券、国元证券、广发证券、东吴证券、广州证券、高华证券、华宝证券、民生证券、中投证券、山西证券、西部证券和华泰证券各1个交易单元，且上述交易单元本期未发生交易量。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内基金无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	关于国投瑞银货币市场基金暂停申购及转入业务的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2010-02-09
2	关于网上直销转换业务申购费补差按网上申购优惠费率执行的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2010-03-24
3	关于国投瑞银货币市场基金暂停申购及转入业务的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2010-06-07
4	关于调整网上直销平台基金申购最低金额限制的公告	《中国证券报》 《证券时报》	2010-07-07

		《上海证券报》	
5	关于国投瑞银货币市场基金暂停 申购及转入业务的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2010-09-16

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银货币市场基金募集的批复》（证监许可[2008]1423号）

《关于国投瑞银货币市场基金备案的确认函》（基金部函[2009]27号）

《国投瑞银货币市场基金基金合同》

《国投瑞银货币市场基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银货币市场基金2010年年度报告原文

12.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一一年三月二十五日