国投瑞银核心企业股票型证券投资基金

第四季度报告

&金管理人的董事会及董事保证本 & 扣个别及连带责任。	§1 重要搜示 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
&金托管人中国工商银行股份有限 分报告等内容,保证复核内容不存在 &金管理人承诺以诚实信用、勤勉师	公司根据本基金合同规定,于2011年1月21日复核了本报告中的财务指标。净值表 应增记高级。误导性练法或者重大遗漏。 境的原则管理和更组基金资化。但不保证基金一定盈利。 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设罚书。
k报告期自 2010 年 10 月 1 日起至	
4F ∧ McShi	§2 基金产品概况
基金简称	国投瑞银核心企业股票
交易代码	121003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年 04 月 19 日
报告期末基金份额总额	6,571,033,428.04
投资目标	追求基金资产长期稳定增值
投资策略	借鉴 USC Global AM 投资管理经验,根据中国市场的特点,采取积极的投资 管理现场。 (一) 指定 USC Global AM 投资管理施程和方法,并加以未土化、投资管理工 其主要设置 GNN 等限学的自己技术。 1 股票的分类的。 1 股票的公司 (1995) 1 以 股票的公司 (1995) 1 以 股票的公司 (1995) 1 以 1 以 1 以 1 年的政府债券不低于 5%。 1 现金和原则由工程过 1 年的政府债券不低于 5%。 1 更全和原则由工程过 1 年的政府债券不低于 5%。 1 更多和原则由工程过 1 年的政府债券不低于 5%。 1 更多的原则,以 1 年的政府债券不同于 5%。 1 更多的原则,以 1 年的政府债券不同, 1 日本市下的债券的市场, 1 平的股票的 在价值。以保管理, 2 地理股票的企业组合, 2 时间, 3 时间, 4 时间, 4 时间, 4 时间, 5 时间
业绩比较基准	业绩比较基准=5%×金融同业存款利率+95%×中信标普 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于预期风险收益较高的基金品种,其预期风险和 预期收益高于债券型基金和混合型基金。
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
.1 主要财务指标	§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人
主要财务指标	报告期 2010年10月01日-2010年12月31日)
1.本期已实现收益	394.785.377.94
2.本期利润	317,107,753.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0468
4.期末基金资产净值	6.397.571.373.9
5.期末基金份額净值	0.9736

为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2.以上所述基金或精标不包括特有人以购或交易基金的各项费用 例如基金申购赎回费、基金粹换费等),计人费用后实际 收益水平聚医于两为规定。

3.2.1 平板市別盘室防御尹恒增长	华及共与问册!	业项压牧盘相	X 益 半 的 C 教			
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 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	4.61%	1.50%	6.33%	1.65%	-1.72%	-0.15%
注:1、本基金业绩比较基准中:同小						
有限公司和标准普尔 Standard & Poor				è市具有行业代	表性的上市公	:司组成,其样2
至过了流动性和财务稳健性的审慎检查			的总体趋势。			
2、本基金对业绩比较基准采用每日	1再平衡的计算	方法。				
222 白北仝公同开始巴本北仝里	计运行输比率:	水分及廿与同 的	付いし 付き口 よたはた 3	Baller みくがにかいことが	5H-46	

1.5440 2.523 JUNE 1.5442 2.523 JUNE TAKE 2705.5 ---\$1\%--\$#F

注: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 81.86%。权证投资占基金净值比例 0%。债券投资占基金净值比例 3.87%。现金和到期日不超过 1 年的政府债券占基金净值比例 18.9%。符合基金合同的相关规定。

姓名	职务	任本基金的基	5金经理期限	证券从业年	说明
生石	\$71.95r	任职日期	离任日期	限	19694
康晓云	本基金基金经理	2006年 04 月 19 日	-	10	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾在昆仑证券、国海证券从事证券投资与研究工作。2004年加入国投瑞银。现兼任国投瑞银瑞福分级基金基金经理。
基纯鹏	本基金基金经理	2010年04月23日	-	8	中国籍,硕士,具有基金从业资格,管 任华林证券研究员,中国建银投资证券高级研究员,泰信基金高级研究员 和基金经理助理,2009年4月加入 国投瑞银。现兼任国投瑞银成长优近基金基金经理。

448以在於前代表现。 4.2 假營駒內本基金运作連經守信情况說明 在报告前內,本基金管理人遵守 征券法》、征券投资基金法》及其系列法规和 個股端很核心企业股票型证券投资基金基金合 等有关规定,本籍合守组信,审核额。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 按规则总基金运作合法台原。没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项规则
4.3 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本准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未现。
以确体生基金管理人群不投资组合在研究,决策、交易执行等各方面的得到公平对待,通过对投资交易行为的监控,分析评估和
信息膨素水加强公平交易指挥电影的宣音,形式一有效的公平交易标系,本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均均
到良好超度彻执行,未发现存在建反公平交易原则纳现象。
4.32 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的动或比较
本报告期内,本公司未管理其他投资成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
导超过 %之情形。
4.33 异常交易行方的专项说明
本报告期内,本基金未发现异常交易行为。
4.4 招步即取出条金的设备被影响成为事的证明
本报告期内,本基金未发现异常交易行为。
4.4 招步即取出条金的设备被影响成者更知识目

本报告期外、本基金米克理异常之易行为。
4.4 报告期收益金份投资额和设施表现说明
4.4 报告期收益金份资额等和运作分析
2.00 年甲專獎。中超影特回卷,其一块疗进一步扩大了量化常於货币政策規模。大京高品价格明显反弹,再加上部分农产品供
市. 4 季度進胀压力急剧上升。11 月份 CPI 同比上升 5.1%,达到两年多来的高点,大幅起出预期。在通胀压力急剧上升的背景 尽行的货币放货链—步攻%。先后加速期次,并三处上调临业银行存款储备金单。
以下部货币放货链—步攻%。先后加速期次,并三处上调临业银行存款储备金单。
以下避查、及时流放空巨大、季和。受用由市场给好及成分还全温彻别附近点。A 段市场一举扭转前期额势,煤炭,有色、金融、交通条 转转等估估值周期性行业均速上涨。出现了恰值修复行情。由于 10 月下旬央行公布加息,明确展示了对连纸等周及资产 设计上涨的担点、特别是市场大大加强了对中央经济工作全级将则继定。10 年 货币及转钟的建稳的调和,是即场地会国系,转已经验机线币政策收紧,加之年来资金面穿常紧张,对中小型股业增低于预期的疑虑加剧等多重因素的共同作用下,A 股市场

4.4. 报告即用基金的业绩表现。 截止股告则未本基金份额净值为0.9736元。木积告期份额净值增长率为4.61%,同期业颁比农基他收益率为6.33%,基金净值 矩半截灰于或绩基他:主要限因在于报告期均基金投票仓位依于基础。 4.5 管理人对求理经验、证券市场及行业类物的观察理想 匿程一季度。站在当前时点上,我们对 A 股近期途势审算不见。而对中长期持中性态度。年初,资金紧张的程度有超级和,产业 资本的增特行为有助于程定操作,体决关系的好样的有助于股市在1 月份延续器及更纯的强。通着年限披露朝的准施。业绩和估值的综合比较成分引导股市结构作价的主线。但上年中通报压力的十分上、紧缩即经效解转频密拍台,否上季度延转到现在的 资金供给编案局面,不能得到显著规划解。则将给市场带来较大的负面影响。 市场被之前随,可能存在的投资的会在于,部分严重依估的周期性监等段;部分优质的成长段在市场风格转换的过程中可能被 错条,进而提供良好的买人机会。

5.1 报告期末基金资产组合情况 247,871,00

设告期末	按行业分类的股票投资组合		金额单位
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 66)
A	农、林、牧、渔业	35,940.00	-
В	采捆业	456, 108, 325.48	7.13
С	制造业	2,816,367,619.50	44.02
C0	食品、饮料	859,304,434.29	13.43
C1	纺织、服装、皮毛	143,064,797.80	2.24
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	133,145,127.57	2.0
C5	电子	-	
C6	金属、非金属	265,678,922.61	4.1:
C7	机械、设备、仪表	706.854.011.21	11.0
C8	医药、生物制品	645,760,326.02	10.0
C99	其他制造业	62,560,000.00	0.98
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	
E	建筑业	177,959,193.17	2.7
F	交通运输、仓储业	19,740,000.00	0.3
G	信息技术业	342,743,360.11	5.30
Н	批发和零售贸易	228,297,287.83	3.5
I	金融、保险业	721,049,917.48	11.2
J	房地产业	301,466,293.62	4.7
K	社会服务业	-	
L	传播与文化产业	_	

告期末	按公允价值占基金	:资产净值比例大小	非序的丽十名股票投资明	細	金额单位:人
序号	股票代码	股票名称	数量 般)	公允价值	占基金资产净值比例 6%)
1	002028	思源电气	9,332,563	245,166,430.01	3.83
2	000513	丽珠集团	5,579,211	244,481,026.02	3.82
3	600887	伊利股份	5,788,374	221,463,189.24	3.46
4	000858	五粮液	6,009,869	208,121,763.47	3.25
5	601601	中国太保	8,773,164	200,905,455.60	3.14
6	601318	中国平安	3,503,083	196,733,141.28	3.08
7	600395	盘江股份	6,009,835	195,620,129.25	3.06
8	600036	招商银行	14,000,000	179,340,000.00	2.80
9	600415	小商品城	4,948,987	173,412,504.48	2.71
		oly Altr Altr Call			

~ш-уш-	420000000000000000000000000000000000000	yr 20 20 yr 20 21 21 21 21 21 21 21 21 21 21 21 21 21			金额单位:
序号		债券品种		公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	国家债券			-	_1
2	央行票据			247,871,000.00	3.87
3	金融债券			-	-1
	其中:政策性金融位	资		-	-
4	企业债券			-	-
5	企业短期融资券			-	-
6	可转债			-	-
7	其他			-	-
8		合计		247,871,000.00	3.87
告期末	按公允价值占基金的	资产净值比例大小排华	名的前五名债券投资	到细	金额单位:
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	1001021	10央行票据 21	1,100,000	107,591,000.00	1.68
	2	0801032	08央行票据 32	800,000	80,208,000.00	1.25
	3	0801017	08央行票据 17	600,000	60,072,000.00	0.94
本想 5.7 本想 5.8 5.8.1 5.8.1	金本报告 报告期末 金本报告 投资组合 本基金封 基金投资	。期末未持有资产支 按公允价值占基金 。期末未持有权证贷 报告附注 殳资的前十名证券:	资产净值比例大小排名 提产。	的前五名权证投资(音部门立案调查的,	明细 在报告编制日前一年内世	2未受到公开谴责、处罚。

79271-75	10H - A3A0 - FAM	金额单位:
序号	名称	金额
1	存出保证金	4,268,707.28
2	应收证券清算款	=
3	应收股利	=
4	应收利息	7,048,172.80
5	应收申购款	130,396.42
6	其他应收款	=
7	待摊费用	=
8	其他	=
9	合计	11,447,276.50
报告期	末持有的外干转股期的可转換债券明细	

报告期期初基金份额总额	7,144,032,608.82
报告期期间基金总申购份额	24,280,759.84
报告期期间基金总赎回份额	597,279,940.62
报告期期间基金拆分变动份额(分额减少以""填列)	=
报告期期末基金份额总额	6,571,033,428.04

各查文件目录 于同意田珍瑞根核心企业股票型证券投资基金(定立的批复)(证监基金 2006 38 号) 投瑞線核心企业股票证券投资基金基金台同) 投瑞線核心企业股票证券投资基金社管协议) 投瑞線核心企业股票证券投资基金社管协议) 本报告期式中国监理职机公司軍程及基金管理、业务资本报告期式中国监查特定与建筑制计上被职的自立公局更全国投端银柱心企业要票型证券投资基金 2010 年第四季度报告原文中国广本沿岸训市国田区全田路 4028 号荣招至贾中心 46 层存设理。此时之中404年 502 号荣招至贾中心 48 层 703 号元 104 元 104 元 105 元 105

8.5 宣周万元 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:400-880-6868 国投瑞银基金管理有限公司 2011-01-24

国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金

第四季度报告

推香建出日期:2011年01月24日 \$1. 重要提示 基金管理人的部单会及前等移证本报告所载资料不存在虚假记载;误导性殊述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和 完整性平衡型的设定前责任。 宗整性朱胖小则及岳带弃任。 基金符约人中国银行股份有限公司根据本基金台同规定,于2011年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性珠达或重大遗漏。 基金管理人承记为诚实信用。她就是预的规则管理和宣用基金的产,但不保证基金一定盈利。 基金的过程或剩余个代表来来表现。投资有效是,投资者在任此股资设置加定用烟溅本基金的招募设明书。 3告期末基金份 U险收益特征 动收益。 人认购或交易基金的各项费用 例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实 - アサロデーニサディー 5.1 报告期末基金资产组合情况 2,292,433,949.69 80.73 80.73

		票投资组合				金额单位:/
代码		行业类别		公	允价值	占基金资产净值比例 66)
A	农、林、牧、渔业				11,098,783.98	0.39
В	采掘业				-	-
С	制造业				110,547,528.87	3.91
C0	食品、饮料				-	
C1	纺织、服装、皮毛				8,619,181.30	0.30
C2	木材、家具				-	-
C3	造纸、印刷				20,050,000.00	0.71
C4	石油、化学、塑胶	、塑料			-	-
C5	电子				18,553,579.50	0.66
C6	金属、非金属				8,129,686.60	0.29
C7	机械、设备、仪表				50,815,587.75	1.80
C8	医药、生物制品				4,379,493.72	0.15
C99	其他制造业				-	
D	电力、煤气及水的	9生产和供应业			-	-
E	建筑业				7,248,251.40	0.26
F	交通运输、仓储业				-	-
G	信息技术业				-	-
Н	批发和零售贸易				7,286,027.10	0.26
I	金融、保险业				-	-
J	房地产业				-	-
K	社会服务业				3,145,235.28	0.11
L	传播与文化产业				-	-
M	综合类				-	-
		合计			139,325,826.63	4.93
设告期:	末按公允价值占基	金资产净值比例大/	排序的前	计名股票投资	明细	金額单位:/
序号	股票代码	匹西かか	44	SE AS V	12414	占基金资产净值比例
775		股票名称	93	量 般)	公允价值	(%)
1	300156	天立环保		400,000	23,200,00	
2	002511	中顺洁柔		500,000	20,050,00	
3	002506	超日太阳		327,580	14,580,58	
4	300124	汇川技术		89,502	12,519,53	9.76 0.44
5	601777	力帆股份		695,863	9,783,83	3.78 0.35
6	601118	海南橡胶		1,539,432	9,221,19	
7	002487	大金重工		204,778	8,129,68	6.60 0.29
8	002482	广田股份		85,515	7,248,25	1.40 0.26
9	002485	希努尔		253,872	7,006,86	7.20 0.25
10 报告期:	300138 末按债券品种分类	展光生物 的债券投资组合		127,163	4,379,49	- '
序号	1	债券品种			2-1A feb	金額单位: / 占基金资产净值比例 %)
	Participa (1811 of the	阿莎伯科		23	允价值	白霉亚贝严伊阻比例 % /
1	国家债券				215 100 000 00	-
2	央行票据 金融债券				215,198,000.00	7.61
3	其中:政策性金屬	LOS			575,642,000.00 575,642,000.00	20.36
4	企业债券	RIDI			1,109,245,231.27	39.24
5	企业短期融资券				1,109,243,231.27	39.24
	-				202 240 710 42	12.00
6	可转债				392,348,718.42	13.88
7	其他	A 11			-	-
8 设告期	末按公允价值占基	合计 全资产净值比例大/	AEZRI	五名债券投资	2,292,433,949.69	81.10
- 1 - 1 7922			- 1 H 2 B1		. , ,,,,,,,,,,	金额单位:/
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	+	2,423,000	286,253,22	
2	126018	08江铜债	+	2,358,920	183,264,49	
3	1001021	10央行票据 21	+	1,800,000	176,058,00	
4	080406	08次发 06	+	1,500,000	150,435,00	
5	090405	09次发 05	-	1,500,000	147,135,00	
设告期:	未按公允价值占基	09次发 05 金资产净值比例大/ 支持证券。 金资产净值比例大/	排名的前	十名资产支持	证券投资明细	
金本根金、金田、金田、金田、金田、田、田、田、田、田、田、田、田、田、田、田、田、田	告期末未持有资产 未按公允价值占基 告期末未持有权证 合报告附注 会投资的前十名证 受资的前十名股票 现代各项资产构成	: 饭产。 券的发行主体本期没 为属于基金合同规定	小排名的前 战有被监管 医备选股票	五名权证投资 部门立案调查 库之内的股票	的,在报告编制日前	一年內未受到公开谴责、处
序号		名称			金額	
1	存出保证金					250,000.00
2	应收证券清算款					7,021,645.50
3	应收股利					
4	应收利息					23,570,876.88
5	应收申购款					1,065,712.70
6	其他应收款					_
7	待摊费用					-
8	其他					_
9		合计				31,908,235.08
报告其	明末持有的处于转	D III	19H	l		
	债券代码	债券名称	1	11444	p-4F-2	金額单位:/
序号	110003		1	公允价值		全资产净值比例 %) 2.41
1	110003	新钢转债 美主转债	1	68,216,16		
	1123731		II.	37,879,33	10.42	1.34
2 报告其	現末前十名股票中	字在流通受限情况的	说明			
	明末前十名股票中	字在流通受限情况的		danae e	Eagle A sec.	金額单位:/
	明末前十名股票中 股票代码	字在流通受限情况的 股票名称	流通	受限部分的 允价值	占基金资产 净值比例 %)	金額单位: // 流通受限情况 说明

	/	002485	411.257/1	/,006,867.20	0.25	MITHMANAEM
	8	300138	晨光生物	4,379,493.72	0.15	网下申购锁定期
5.8	.6 本基金	本期未投资社	.管行股票、未投资控股 本基金管理公司的规定	股东主承销的证券,未从	二级市场主动投资分离?	交易可转惯附送的权证,
< PX	NE STANCE	IXTHIX(ZINUX	平38並昌建公司的死足	§6 开放式基金份额变动	h	a.
	报告期期	用初基金份额总	2額			2,556,529,487.66
	报告期期	间基金总申购	均份额			1,908,655,799.51
	报告期期	间基金总赎回	目份额			1,743,501,028.07
	报告期期	间基金拆分变	E动份額 (分額减少以 =	"填列)		-
		用末基金份额总				2,721,684,259.10
7.1	报告期P 报告期内	内本公司对本制 内本公司对本制	\$7 《金进行收益分配、每1 《金暂停大额申购及转》	納投资者决策的其他重 0份基金份额派发红利0、 业务进行公告。指定媒体 \$8 备查文件目录	要信息 80 元。指定媒体公告时间 公告时间为 2010 年 12	則为 2010 年 12 月 15 日。 月 30 日。
0	久本から	+H-2-		20 m = X H D %		

9,783,833.78

长于同意国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金设立的批复》(证监基金 2007 1332 号) 长于国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金备案确认的函》(基金部函 2008 16 号)

8.3 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:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司 2011_01_24

报告送出日期 - 2011年 01月 24日

\$1 重要提示 基金管理人的董事会及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 2540 全型以关键 2542 整性承担个别及差帶责任 基金計管人中国工商銀行股份有限公司根据本基金合同原定,于2011年1月21日复核了本报告中的财务指标。净值表现和股 货租合股告等内容 保证复核内容不存在建度记载,误导性叛连或者重大造漏。 基金管理人承诺以该次信用,勤勉尽前的原则管理和应用基金资产。但不保证基金一定盈利。 基金合理性业排千代党其长来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策的应仔细阅读本基金的招募设明书。 本报告中财务资料未经审计。

基金简称	国投瑞银沪深 300 指数分组	及				
交易代码	161207					
基金运作方式	小唐份額 简称 點和小唐	本基金的基金价额包括本基金之基础份额 領錄 樂和 300 份额")。本基金,由非份鄉 領務 第和中最份鄉 与本基金之虚旧份鄉 简称 實和应足份。 第"》,其中,蔣和中,每份縣。蔣和亞足份鄉的基金份额配比對於與特 11 的日本不变,第和 300 份额开递给外与场内两种方式的申购与赎回。蓬和 14 數值额与端和远记价额在深圳市泰文局所上市交易				
基金合同生效日	2009年 10 月 14 日					
报告期末基金份额总额	2,373,937,165.05					
投资目标	将基金净值收益率与业绩	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深 300 指数的有效跟踪,力对将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。				
投资策略	进行相应地调整,以复制和 当因特殊情况 如股权分置 时,基金管理人可以对基金	本基企为解动式指挥放金。原则上采用指数复制控销策略,控照个投在床足 指挥中的路地双重转程即得低台。并得根基地指数或份别及其权重的变元 进行和5地调整。以复制和调整基地指数 进行和5地调整。以复制和调整基地指数 过路转转指在。即此权分量或分等,跨载基金无法有效量制和调整基地指数 时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的增 及下。输出金管使力工具并行检管理,从有效等越差全的翻锁的				
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%	×沪深 300 指数收益率+	5%×银行同业存款利率			
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于 险高于货币市场基金、债券	高风险、高收益的基金。 型基金和混合型基金。	品种,其预期收益和预期。			
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	3]				
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	ii ii				
下属三级基金的基金简称	国投瑞银瑞和沪深 300 指 数	国投瑞银瑞和小康沪 深 300 指数	国投瑞银瑞和远见沪 深 300 指数			
下属三级基金的交易代码	161207	150008	150009			
报告期末下属三级基金的份额总额	774,555,333.05	799,690,916.00	799,690,916.00			

2、以上所法基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用《例如基金申购赎回费、基金转换费等》,计入费用后实际 协会小平理样干部创始。

3.2	2 基金净值表现 2.1 本报告期基金份额净值增长:	率及其与同期:	业绩比较悲准时	女益率的比较			
	阶段	净值增长率	净值增长率 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
Γ	过去三个月	6.07%	1.68%	6.28%	1.68%	-0.21%	0
注	:1、本基金是以沪深 300 指数为	际的指数的被运	动式指数型基金	企 ,对沪深 300	指数成份股和	备选成份股的	配置不低于 8
95%	×沪深 300 指数收益率+5%×银行	同业存款利率	作为本基金业	绩比较基准。			
2.	本基金对业绩比较基准采用每日	再平衡的计算	方法。				

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 THE ROLL THE ROLL OF STREET Principle property and the second -2457 -2413

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金

第四季度报告

注: 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 94.44%。权证投资占基金净值比例 9%。债券投资占基金净值比例 06。现金知识即日不超过 1 年的政府债券上基金净值比例 5.77%。符合基金金面均归至知识

姓名	职务	任本基金的基	金经理期限	证券从业年	说明
X2-43	RX.95	任职日期	离任日期	阳	19093
LU RONG QIANG	本基金基金经理、国际业务部副总监	2009年 10 月 14 日		11	澳大利亚裔,澳大利亚新南威尔 土大学基金管理专业硕士,具有 基金从业资格。曾任康联首域投 资基金公司投资经理。投资分析 协工联邦基金公司数量分析员 投资缩交分析员;美世投资管理 月加入且控谐银、现兼任国投瑞 银新兴市场服票。QDII-LOF)基 金基金经理。
熊志勇	本基金基金经理	2010年11月27日		6	中国籍,英国考文垂大学博士研究生,具有基金从业资格。曾任职于天狮投资中心、华安基金管理有限公司,从事量化分析和证券研究工作。2009年12月加人国特瑞锡。

分衣产品供给冲击,4季度通胀压力急剧上升,其中,11月份CPI同比上升5.1%,达到两年多来的高点,大幅超出预期。在通胀压力 急剧上升的背景下,央行的货币政策进一步收紧,先后加息两次共计0.5个百分点,并上调商业银行存款准备金率共计1.5个百分

报告期初,受棄理第二次量化宽松胶黄影响。A股市场周期行业比现大幅上涨,但非周期股却开始调整,随后市场出现风格轮前期佔值偏低大盘股表现明显强于前期估值偏高的小盘股。作为指数基金,投资操作以严格控制限紧以差为主,同时也密切关

26. 市时间由额形入业化心中的起源。19. 市时间由额中的"自然体血",这样称为 41. 产业的电路 20人 注意。中等原则自然企业情况到 载上报告期内基金的业绩表现 载上报告期末。未在金份额等值的 0.93 元、本报告期份额等值增长率为 6.07%,同期业绩基准增长率为 6.28%,基金净值增长 率落后连续基准收益单 0.21%,主要属于报告期内基金大咖啡则赎回时或等,报告期内,日生期除误差为 0.00%,年代服务误差为 1019。符合基金的分别的定证的就是是不包包。2018年

			金额单位:人
字号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,181,344,772.93	94.2
	其中:股票	2,181,344,772.93	94.2
2	固定收益投资	=	-
	其中:债券	=	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	=	-
4	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	133,365,660.07	5.70
6	其他资产	618,492.02	0.03
7	合计	2,315,328,925.02	100.00

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 66)
A	农、林、牧、渔业	8,216,075.63	0.36
В	采捆业	283,652,488.21	12.28
С	制造业	771,792,241.53	33.42
C0	食品、饮料	124,704,815.27	5.40
C1	纺织、服装、皮毛	7,573,664.84	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	52,523,175.97	2.27
C5	电子	11,138,289.36	0.48
C6	金属、非金属	187,871,618.79	8.13
C7	机械、设备、仪表	281,140,692.64	12.17
C8	医药、生物制品	98,607,602.70	4.27
C99	其他制造业	8,232,381.96	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	53,217,013.25	2.30
E	建筑业	67,043,715.99	2.90
F	交通运输、仓储业	95,542,465.68	4.14
G	信息技术业	73,750,084.93	3.19
Н	批发和零售贸易	67,041,005.92	2.90
I	金融、保险业	577,654,557.77	25.01
J	房地产业	108,697,702.22	4.71
K	社会服务业	19,732,650.96	0.85
L	传播与文化产业	3,203,112.50	0.14
M	综合类	49,769,464.74	2.15
	合计	2,179,312,579.33	94.36
设告期	末(积极投资)胺行业分类的股票投资组合		金额单位:
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 64.)

2,839,480,095.1

渦	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 %)
A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
CO	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
Н	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	2,032,193.60	0.09
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,032,193.60	0.09

产净值比例 66)	公允价值	数量 般)	股票名称	股票代码	序号
3.31	76,354,742.88	1,359,593	中国平安	601318	1
3.00	69,199,543.14	5,401,994	招商银行	600036	2
2.11	48,719,457.76	8,890,412	交通银行	601328	3
2.10	48,395,581.08	9,640,554	民生银行	600016	4
1.88	43,391,659.35	1,804,227	兴业银行	601166	5
1.66	38,352,650.28	3,095,452	浦发银行	600000	6
1.56	36.041.040.48	2,862,672	中信证券	600030	7
1.43	32,966,624.11	1,334,141	中国神华	601088	8
1.40	32,311,660.98	3,930,859	万科A	000002	9
1.26	29,118,128.60	1,271,534	中国太保	601601	10
金额单位:	明细	大小排序的前五名股票投资	基金资产净值比例	符安公允价值占	只极投资
产净值比例 66)	公允价值	数量 般)	股票名称	股票代码	序号
0.09	2,032,193.60	149,426	安信信托	600816	1

1 1 2	报告期末 金本期末 金本期报末 金本期报告 金本期报告 金本组合 本。 金金 金金 金金 金金 金 金 金 金 金 金 金 名 一 一 一 一 一 一		名资产支持证券投资明细 名权证投资明细 立案调查的,在积告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。
	序号	名称	金額
	1	存出保证金	556.335.49
	2	应收证券清算款	=
	3	应收股利	-
	4	应收利息	28.623.04
	5	应收申购款	33,533.49
	6	其他应收款	-
	7	待摊费用	-
	8	其他	=
	9	合计	618,492.02
5	.1 期末指 金本期末	末持有的处于转股期的可转換债券明细 期末持有可转换债券。 該投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。 1度投资的十分股票中本方法通過限据的说明 1度投资的	

建2	金本期末	指数投资前十	权宗中存在流画S 名股票中不存在流 股票中存在流通S	通受限情况。					
	序号	股票代码	股票名称	数量 段)		公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说 明	
	1	600816	安信信托	149,426		2,032,193.60	0.09	重大事项	1
.8.6 E券			行股票、未投资哲 金管理公司的规定	:股股东主承销的证 [。 §6 开放式基:			6分离交易。	丁转惯附送的权证 ,	投资流通单位:份
项目 国投瑞银瑞和沪深 300 指 国投瑞银瑞和小康沪 医投瑞银瑞和远界 数 深 300 指数 深 300 指数									
	报告期期	用初基金份额总	額	251,542	,849.59	887,552,	827.00	887,552,827.00	

	THE REPORT OF THE PARTY OF THE PARTY OF	2011042104727	00773327027.00	007 1332 1027 300		
	报告期期间基金总申购份额	1,506,567,987.20	167,975,636.00	167,975,636.00		
	报告期期间基金总赎回份额	968,317,987.02	217,979,703.00	217,979,703.00		
	报告期期间基金拆分变动份额(分额减 少以""填列)	-15,237,516.72	-37,857,844.00	-37,857,844.00		
	报告期期末基金份额总额	774,555,333.05	799,690,916.00	799,690,916.00		
7.2 7.3 7.4	报告期内本公司对本基金办理份额折算业 报告期内本公司对本基金办理份额折算独 报告期内本公司对本基金办理份额折算结 报告期内本公司增聘能志勇为本基金基金 备香文件目录	务及瑞和小康、瑞和远见停牌 果及恢复交易进行公告。指定	事项进行公告。指定媒体公 媒体公告时间为 2010 年 10			
Al if 正人中1-8。 长于核相阻限端限率的序等 200 指数分级证券投资基金募集的批复》(配监许可 2009 365 号) 长于报始显视器率的序等 200 指数分级证券投资基金条案编认构造) 低金部第 2009 366 号) 值股端据解和序案 200 指数分级证券投资基金帐置的以 值取端据解和序案 200 指数分级证券投资基金帐置的以 即选辑继基金融管和模拟。四个可能及是金融管理						

關稅辦議基金管理有限公司當此收集。公司章程及基金管理人业务资格批本税告期的企用医监查指院宣复监察报刊上接额的信息公告款文 国稅辦議辦部企業 200 指数分级业券投资基金 2010 年第四季度报告原文 中国广东省资利市福田区全国辖 4028 号乘超经货中心 46 层 存款例出,由p.45ww.ubsedic.com 8.3 查询方式 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。4058—6688

国投瑞银基金管理有限公司 2011-01-24