

国投瑞银景气行业证券投资基金 2010 年年度报告摘要

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:中国光大银行股份有限公司
送出日期:2011年03月25日
重要提示:
基金管理人承诺: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责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:国投瑞银景气行业混合型证券投资基金
基金代码:121002
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司

投资目标:本基金的投资目标是:积极投资,追求适度风险收益,即采取积极混合型投资策略,把握景气行业先锋股的投资机会,在有效控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略:本基金采用自上而下和自下而上的投资策略,在有效控制风险的基础上追求基金资产的长期稳健增值。

3.1 期间数据和指标
2010年 2009年 2008年
本期已实现收益 206,484,499.92 999,492,516.51 -1,231,819,633.21
本期利润 118,653,373.36 1,496,284,364.50 -1,898,069,675.00

3.2 基金管理人及基金托管人
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

3.3 主要会计数据和财务指标
3.3.1 期间数据和指标
2010年 2009年 2008年
本期已实现收益 206,484,499.92 999,492,516.51 -1,231,819,633.21
本期利润 118,653,373.36 1,496,284,364.50 -1,898,069,675.00

3.3.2 基金管理人及基金托管人
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

3.3.3 主要会计数据和财务指标
3.3.3.1 期间数据和指标
2010年 2009年 2008年
本期已实现收益 206,484,499.92 999,492,516.51 -1,231,819,633.21
本期利润 118,653,373.36 1,496,284,364.50 -1,898,069,675.00

3.3.3.2 基金管理人及基金托管人
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

3.3.3.3 主要会计数据和财务指标
3.3.3.3.1 期间数据和指标
2010年 2009年 2008年
本期已实现收益 206,484,499.92 999,492,516.51 -1,231,819,633.21
本期利润 118,653,373.36 1,496,284,364.50 -1,898,069,675.00

3.3.3.3.2 基金管理人及基金托管人
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

3.3.3.3.3 主要会计数据和财务指标
3.3.3.3.3.1 期间数据和指标
2010年 2009年 2008年
本期已实现收益 206,484,499.92 999,492,516.51 -1,231,819,633.21
本期利润 118,653,373.36 1,496,284,364.50 -1,898,069,675.00

3.3.3.3.3.2 基金管理人及基金托管人
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

3.3.3.3.3.3 主要会计数据和财务指标
3.3.3.3.3.3.1 期间数据和指标
2010年 2009年 2008年
本期已实现收益 206,484,499.92 999,492,516.51 -1,231,819,633.21
本期利润 118,653,373.36 1,496,284,364.50 -1,898,069,675.00

3.3.3.3.3.3.2 基金管理人及基金托管人
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

3.3.3.3.3.3.3 主要会计数据和财务指标

较好地回避了政策影响带来的市场下跌,下半年资产配置相对均衡,分享了周期性行业的估值修复,并重点精选了大消费新兴产业的个股获得了一定超额收益。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望 2011 年,通胀和流动性过剩依然是影响市场走势的主题,我们认为通胀在 2011 年大部分时间都将维持较高水平,在通胀得到有效控制之前,大股市场整体上难以摆脱震荡态势,并且在 CPI 出现滞涨波动的时点上,通胀压力将会给 A 股市场带来较大的冲击,另外 2010 年板块结构性估值失衡压力逐渐释放,也是导致市场波动的主要原因之一。随着结构性估值压力的释放,如果增长放缓,通胀得到控制,则周期性行业会迎来从悲观预期历史估值回归的过程,2011 年更多的将是相对均衡的配置策略和向下而上的个股选择。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人从基金估值业务的组织机制、估值委员会、估值小组及运营部,合规与风险控制委员会等方面对估值程序进行了说明,并基金估值程序进行了监督,估值小组跟踪进行估值,设定估值程序及特别估值程序,估值小组由基金运营部估值专员、估值核算员、基金估值或基金资产管理以及监察稽核指定人员、运营部负责日常基金的估值业务,执行基金估值政策,设立基金估值核算岗位负责估值日常业务,基金管理人参与估值的相关人员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。

5.1 报告期内本基金托管人履职情况说明
2010 年度,中国光大银行在国投瑞银景气行业证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同及其他托管协议,履行了托管人应尽的职责,切实维护了基金投资人的利益,基金托管人对基金管理人履行了基金托管人应尽的职责,未发现基金管理人有违反法律法规、基金合同及其他托管协议的行为,基金管理人参与估值程序的相关人员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。

6. 审计意见
经安永华明会计师事务所审计,注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告全文查看审计报告全文。

7.1 资产净值
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.2 和回报
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.3 所有资产权益
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.4 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.5 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.6 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.7 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.8 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.9 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.10 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.11 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.12 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

7.13 投资组合
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
基金管理人:包爱霞
基金托管人:石立平

中国证监会颁布的相关规定制定。
本财务报表以本基金持续经营为基础列报。
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定
7.4.4 本财务报表以公允价值为基础列报,公允完整地反映了本基金于 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更
7.4.6 前期差错更正
7.4.7 关联方关系
7.4.8 关联方交易
7.4.9 关联方关系
7.4.10 关联方交易

7.4.11 关联方关系
7.4.12 关联方交易
7.4.13 关联方关系
7.4.14 关联方交易
7.4.15 关联方关系
7.4.16 关联方交易

7.4.17 关联方关系
7.4.18 关联方交易
7.4.19 关联方关系
7.4.20 关联方交易
7.4.21 关联方关系
7.4.22 关联方交易

7.4.23 关联方关系
7.4.24 关联方交易
7.4.25 关联方关系
7.4.26 关联方交易
7.4.27 关联方关系
7.4.28 关联方交易

7.4.29 关联方关系
7.4.30 关联方交易
7.4.31 关联方关系
7.4.32 关联方交易
7.4.33 关联方关系
7.4.34 关联方交易

7.4.35 关联方关系
7.4.36 关联方交易
7.4.37 关联方关系
7.4.38 关联方交易
7.4.39 关联方关系
7.4.40 关联方交易

7.4.41 关联方关系
7.4.42 关联方交易
7.4.43 关联方关系
7.4.44 关联方交易
7.4.45 关联方关系
7.4.46 关联方交易

7.4.47 关联方关系
7.4.48 关联方交易
7.4.49 关联方关系
7.4.50 关联方交易
7.4.51 关联方关系
7.4.52 关联方交易

7.4.53 关联方关系
7.4.54 关联方交易
7.4.55 关联方关系
7.4.56 关联方交易
7.4.57 关联方关系
7.4.58 关联方交易

7.4.59 关联方关系
7.4.60 关联方交易
7.4.61 关联方关系
7.4.62 关联方交易
7.4.63 关联方关系
7.4.64 关联方交易

7.4.65 关联方关系
7.4.66 关联方交易
7.4.67 关联方关系
7.4.68 关联方交易
7.4.69 关联方关系
7.4.70 关联方交易

7.4.71 关联方关系
7.4.72 关联方交易
7.4.73 关联方关系
7.4.74 关联方交易
7.4.75 关联方关系
7.4.76 关联方交易

7.4.77 关联方关系
7.4.78 关联方交易
7.4.79 关联方关系
7.4.80 关联方交易
7.4.81 关联方关系
7.4.82 关联方交易

7.4.83 关联方关系
7.4.84 关联方交易
7.4.85 关联方关系
7.4.86 关联方交易
7.4.87 关联方关系
7.4.88 关联方交易

7.4.89 关联方关系
7.4.90 关联方交易
7.4.91 关联方关系
7.4.92 关联方交易
7.4.93 关联方关系
7.4.94 关联方交易

7.4.95 关联方关系
7.4.96 关联方交易
7.4.97 关联方关系
7.4.98 关联方交易
7.4.99 关联方关系
7.5.00 关联方交易

7.5.01 关联方关系
7.5.02 关联方交易
7.5.03 关联方关系
7.5.04 关联方交易
7.5.05 关联方关系
7.5.06 关联方交易

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)