国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30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
报告送出日期:2011年10月26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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银稳健增长混合
基金主代码	121006
交易代码	前端:121006 后端:128006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月11日
报告期末基金份额总额	3,799,677,961.15份
投资目标	通过股票与债券等资产的合理配置,追求收益与风险的平衡,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	采取主动的类别资产配置策略,注重风险与收益的平衡。借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验,精选具有资源优势的优质上市公司股票和较高投资价值的债券,力求实现基金资产的长期稳定增长。 1、类别资产配置 股票投资比例为40%-80%,债券投资比例为0-60%,权证投资比例为0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于5%。 2、股票投资管理 以自下而上的公司基本面全面分析为主,挖掘具有资源优势的优质上市公司股票,并使用GEVS模型等方法评估股票的内在价值。 3、债券投资管理 借鉴UBS Global AM固定收益组合的管理方法,采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。 4、权证投资策略 考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。
业绩比较基准	业绩比较基准=中信标普300指数×60%+中信标普全债指数×40%
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-129,417,002.63
2.本期利润	-386,198,274.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1086
4.期末基金资产净值	3,542,725,426.49
5.期末基金份额净值	0.932

注:1、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。

2、以上所述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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

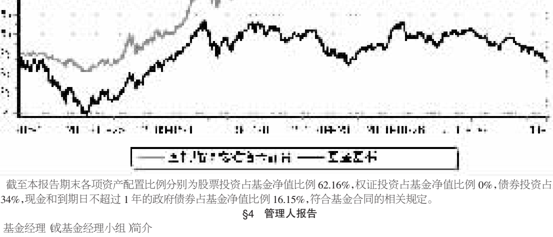
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-9.86%	0.97%	-9.57%	0.79%	-0.29%	0.18%

注:1、本基金属于混合型基金,一般情况下,本基金股票投资占基金资产的比例为40%-80%,债券投资占基金资产的比例为0-60%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基于本基金的资产配置比例范围,我们选用市场代表性较好的中信标普300指数和中信标普全债指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

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股票投资占基金净值比例62.16%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例11.34%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例16.15%,符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
马少章	本基金基金经理	2009年4月8日	-	13	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任职于金信证券、东吴基金及红塔证券。2008年4月加入国投瑞银。曾任国投瑞银沪深300金融地产指数基金基金经理。现兼任国投瑞银景气行业基金基金经理。
朱红裕	本基金基金经理	2011年5月20日	-	6	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任职于华夏证券、银河基金管理有限公司、华安基金管理有限公司,2010年6月加入国投瑞银。

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遵规守信情况的说明

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《国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

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的说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

国内方面,在上半年六次上调存款准备金率、三次加息之后,货币政策在保持从紧的前提下进入观察期。CPI在7月创出年内新高以后逐步回落,物价上涨压力在三季度末略有缓和;但实体经济也受到了紧缩政策的影响,反应经济景气程度的制造业经理采购指数(PMI)三季度一直低位徘徊,房地产成交量持续萎缩,汽车销量增速下滑,市场开始担心经济萎缩会对企业盈利带来的负面影响。

海外方面,欧洲债务危机一波三折,统一货币下各国财政政策没有统一,导致在一些国家债务出现问题的情况下很难找到有效的解决之道,其最终解决需要欧洲各国共同努力下的大智慧;而美国三季度的经济数据(特别是就业数据)也一直复苏慢于预期,海外市场也经历了大幅下跌,并对国内市场造成了较大负面影响。

以沪深300指数计A股市场三季度大幅下挫15.2%。考虑到国内紧缩与海外市场对A股市场的不利影响,本基金在三季度适度降低了股票仓位并坚持“消费+低估值”的防守型配置,增持了医药、零售和TMT等消费属性强的一些个股,取得了一定的超额收益,但是三季度总体较高的股票仓位仍对净值造成了损失。

债券方面,由于央行货币政策继续保持紧缩态势,7、8月份资金面持续收紧。而后随着海外资本市场动荡加剧、国内经济增速继续下滑,央行通过公开市场操作注入流动性,债券市场的流动性明显改善。受此影响,三季度债券市场先抑后扬,但从整个季度来看,债券收益率继续上行,收益率曲线继续呈现熊市平坦化格局。分品种看,包括国债、金融债在内的利率产品表现相对较好。在供应大幅增加、经济下滑担忧的影响下,信用产品收益率上行幅度较大,信用利差进一步扩大。本基金在报告期内增加了可转债的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.932元,本报告期份额净值增长率为-9.86%,同期业绩比较基准收益率为-9.57%,基金净值增长率略低于业绩基准,主要因为报告期内基金的整体股票仓位仍然较高于基准,在市场大幅下跌的过程中对净值带来了负面影响。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年四季度,总体上我们预计国内外形势仍不会大幅好转,所以市场总体仍将维持弱势震荡格局,但一些积极信号的出现可能会促发市场的阶段性反弹。国内方面,紧缩政策对经济增长和企业盈利的负面影响预计在四季度和2012年一季度集中体现,我们担心企业盈利预期在四季度将面临下调,从而对股价造成不利冲击;同时,政策在12月中央经济工作会议前预计不会有大的转向,仍然维持从紧的大基调,欧债危机也可能仍有反复,所以整体市场我们预计仍以弱势震荡为主。但另一方面,在CPI下来以后,政策方面会可能会有局部松动(或者市场预期松动),如温州地区出现高利贷外逃以后政府出台的专门针对中小企业的财税政策等,从而引发市场的阶段性反弹。

四季度我们仍将维持谨慎的操作策略,维持前期“稳定+低估值”的配置,加大对高成长中小市值股票的挖掘与配置。同时,四季度政策变化可能性较大,我们将保持对政策的高度关注,适时灵活调整我们的投资策略。

债市方面,我们预计四季度央行货币政策将转为中性,如果四季度中国经济出现超预期的下行,央行货币政策则存在明显放松可能。总的来看,基本面将对债市将更为有利,本基金将择机增加对债券资产的配置。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	权益投资	2,202,265,988.37	61.82
	其中:股票	2,202,265,988.37	61.82
2	固定收益投资	401,709,837.12	11.28
	其中:债券	401,709,837.12	11.28
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	381,000,971.50	10.69
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	572,148,865.85	16.06
6	其他各项资产	5,499,725.65	0.15
7	合计	3,562,625,388.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	32,547,448.98	0.92
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,573,303,345.49	44.41
C0	食品、饮料	753,456,007.32	21.27
C1	纺织、服装、皮毛	87,196,187.84	2.46
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,775,704.04	0.81
C5	电子	43,797,890.70	1.24
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	53,193,912.39	1.50
C8	医药、生物制品	606,883,643.20	17.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,541,241.13	0.10
E	建筑业	15,470,415.00	0.44
F	交通运输、仓储业	11,962,084.80	0.34
G	信息技术业	12,136,389.38	0.34
H	批发和零售贸易	87,747,695.50	2.48
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	465,557,368.09	13.14
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,202,265,988.37	62.16

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	14,464,104	264,693,103.20	7.47
2	000858	五粮液	7,124,735	258,627,880.50	7.30
3	600062	双鹤药业	11,122,626	216,668,754.48	6.12
4	000002	万科A	28,451,360	205,987,846.40	5.81
5	600276	恒瑞医药	6,908,171	200,751,449.26	5.67
6	002004	华邦制药	2,885,334	119,972,187.72	3.39
7	600048	保利地产	12,550,732	116,094,271.00	3.28
8	600383	金地集团	23,004,559	112,032,202.33	3.16
9	002036	宜科科技	6,179,744	87,196,187.84	2.46
10	600519	贵州茅台	437,638	83,409,426.42	2.35

5.4 报告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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	401,709,837.12	11.34
8	其他	-	-
9	合计	401,709,837.12	11.34

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	2,540,770	222,088,705.70	6.27
2	113001	中行转债	1,080,110	98,279,208.90	2.77
3	125089	深机转债	869,995	81,341,922.52	2.30

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券中,包括“五粮液”7,124,735股,市值25,863万元,占基金资产净值7.3%。根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月27日公告,由于该公司存在信息披露不及时、不完整行为,中国证监会对该公司以及公司相关责任人员依法实施了警告和罚款的处罚。基金管理人认为,该处罚有利于促进公司加强对信息披露工作的管理,进一步规范公司的治理结构,处罚对公司今年以来的经营活动没有产生实质性影响,未改变公司基本面,尚不足以影响基金的投资策略。

除上述情况外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.8.3 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	2,673,571.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,193,341.00
5	应收申购款	1,632,813.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,499,725.65

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	222,088,705.70	6.27
2	113001	中行转债	98,279,208.90	2.77

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,242,351,992.98
本报告期基金总申购份额	812,386,765.78
减:本报告期基金总赎回份额	255,060,797.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,799,677,961.15

§7 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内本基金无其他重大事项。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]449号)
《关于核准国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金备案的确认函》(基金部函[2008]247号)
《国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
《国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
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
国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金2011年第三季度报告原文

8.2 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

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
二〇一一年十月二十六日

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2011年10月26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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银优化增强债券	
基金主代码	121012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年9月8日	
报告期末基金份额总额	1,039,094,699.60份	
投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险和保持资金流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金采取稳健灵活的投资策略,通过固定收益类金融工具的主动管理,力求降低基金净值波动风险,并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测,适度参与一级市场新股和增发新股的申购以及二级市场的股票投资,力求提高基金总体收益率。	
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国投瑞银优化增强债券A/B	国投瑞银优化增强债券C
下属两级基金的交易代码	121012(前端)/128012(后端)	128112
报告期末下属两级基金的份额总额	662,845,474.26份	376,249,225.34份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)	
	国投瑞银优化增强债券A/B	国投瑞银优化增强债券C
1.本期已实现收益	-11,615,317.51	-5,914,242.28
2.本期利润	-35,512,698.82	-13,482,565.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0400	-0.0316
4.期末基金资产净值	621,339,633.52	351,145,684.38
5.期末基金份额净值	0.937	0.933

注:1、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。

2、以上所述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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

国投瑞银优化增强债券A/B

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	-4.68%	0.31%	-1.82%	0.16%	-2.86%	0.15%

国投瑞银优化增强债券C

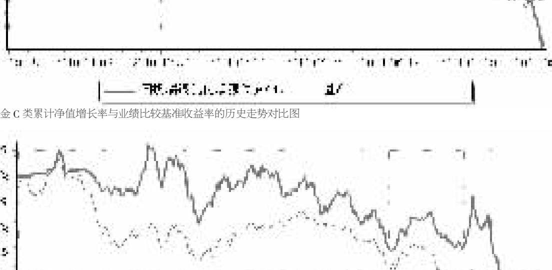
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.80%	0.32%	-1.82%	0.16%	-2.98%	0.16%

注:1、本基金以中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%作为业绩比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,具有权威性,适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

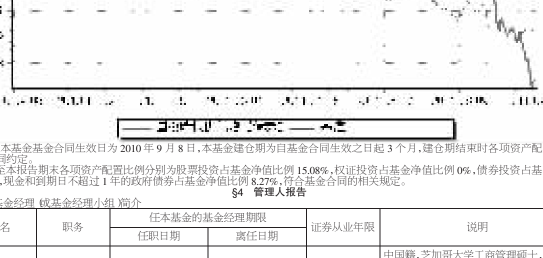
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

本基金A/B类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、本基金基金合同生效日为2010年9月8日,本基金建仓期为自基金合同生效之日起3个月,建仓期结束时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15.08%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例95.81%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例8.27%,符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
李怡文	本基金基金经理	2010年9月8日	-	10	中国籍,芝加哥大学工商管理硕士,具有基金从业资格。曾任Froley Revy Investment Company分析师、中国建设银行(香港)资产组合经理。2008年6月加入国投瑞银。

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遵规守信情况的说明

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《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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的说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入三季度,央行货币政策继续保持紧缩态势,央行在7月份实施了年内的第三次加息,并在8月份宣布扩大商业银行存款准备金缴纳范围,资金面持续收紧。而后随着海外资本市场动荡加剧、国内经济增速继续下滑,央行通过公开市场操作注入流动性,债券市场的流动性在9月份有明显改善。受此影响,三季度债券市场先抑后扬,但从整个季度来看,债券收益率继续上行,收益率曲线继续呈现熊市平坦化格局。分品种看,包括国债、金融债在内的利率产品表现相对较好。而在供应大幅增加、经济下滑担忧的影响下,信用产品收益率大幅上行,信用利差进一步扩大,中低等级信用产品受到的冲击尤其大,债券市场首次出现双位数收益率的债券。而可转债市场则在股市难有起色、债券收益率持续上行、供应增加等诸多负面因素的冲击下,出现大幅下跌,本基金债券持有的可转债资产对基金净值造成较大拖累。在股票投资上,尽管三季度本基金坚持“消费+低估值”的防守型配置,但在股票市场大幅下挫15.2%(沪深300指数)情况下,总体较高的股票仓位仍对净值造成了一定损失。本基金在本报告期内增加中长期限的利率产品配置,对可转债和股票资产作了适当减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,国投瑞银优化增强债券A/B级份额净值为0.937元,国投瑞银优化增强债券C级份额净值为0.933元,本报告期国投瑞银优化增强债券A/B级份额净值增长率-4.68%,国投瑞银优化增强债券C级份额净值增长率-4.8%,同期业绩比较基准收益率为-1.82%。基金份额净值增长率低于业绩比较基准,主要因为本基金持有的可转债和股票资产对净值造成较大负面影响。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于外围经济形势难见起色,出口在四季度将受到较为明显的负面影响,受此影响,我们预计中国经济在四季度将继续筑底,中国经济将出现经济增长和通胀压力双双回落的格局。央行货币政策也将转为中性,如果四季度中国经济出现超预期的下行,央行货币政策则存在明显放松可能。总的来看,基本面将对债市将更为有利,本基金或将择机继续延长组合久期。而经过四季度的大幅调整,可转债市场的投资价值突出,很多个券债底已经对转债价值形成较好支撑,未来如有调整,本基金将增加对转债资产的配置。对于股票市场我们仍将维持谨慎的操作策略,在合理控制股票仓位,维持前期“稳定+低估值”的配置,适时加大对高成长中小市值股票的挖掘与配置。同时,四季度政策变化可能性较大,我们将保持对政策的高度关注,适时灵活调整我们的投资策略。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	权益投资	146,653,373.93	12.82
	其中:股票	146,653,373.93	12.82
2	固定收益投资	931,743,320.25	81.46
	其中:债券	931,743,320.25	81.46
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	50,403,612.99	4.41
6	其他各项资产	14,977,558.70	1.31
7	合计	1,143,777,865.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	118,424,864.41	12.18
C0	食品、饮料	49,681,290.00	5.11
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	8,658,361.48	0.89
C5	电子	10,000.00	0.00
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	3,035,595.03	0.31
C8	医药、生物制品	33,027,117.90	3.40
C99	其他制造业	24,012,500.00	2.47
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,005,729.72	0.41
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,062,464.00	0.52
H	批发和零售贸易	9,509,395.80	0.98
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	9,650,920.00	0.99
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	146,653,373.93	15.08

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	1,819,710	33,300,693.00	3.42
2	002610	爱康科技	1,250,000	24,012,500.00	2.47
3	600062	双鹤药业	974,500	18,983,260.00	1.95
4	000002	万科A	1,333,000	9,650,920.00	0.99
5	000759	中百集团	1,009,490	9,509,395.80	0.98
6	002440	闰土股份	424,846	8,658,361.48	0.89
7	000729	燕京啤酒	564,600	8,310,912.00	0.85
8	600276	恒瑞医药	212,242	6,167,752.52	0.63
9	600498	烽火通信	179,600	5,044,964.00	0.52
10	000895	双汇发展	76,233	4,955,145.00	0.51

注:本基金投资的前十名证券中,000759中百集团于2011年4月14日起由于重大资产重组事项停牌,本公司在该股停牌期间以中证协SAC行业指数作为计算依据,自2011年9月28日起对该股采用“指数收益法”进行估值调整。2011年9月30日该股复牌,由于全天仅在跌停板价格有较少成交,可判断未达到活跃市场交易状况,经协商,本公司决定继续对该股以指数收益法进行估值。10月10日该股达到活跃市场状况,本公司对该股恢复采用收盘价估值。

5.4 报告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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,976,000.00	3.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	168,424,000.00	17.32
	其中:政策性金融债	168,424,000.00	17.32
4	企业债券	557,517,165.40	57.33
5	企业短期融资券	19,764,000.00	2.03
6	中期票据	-	-
7	可转债	156,062,154.85	16.05
8	其他	-	-
9	合计	931,743,320.25	95.81

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	1,987,160	177,850,820.00	18.29
2	112015	09泛海债	924,194	93,325,110.12	9.60
3	100236	10国开36	600,000	59,664,000.00	6.14
4	110015	石化转债	679,800	59,421,318.00	6.11
5	110216	11国开16	600,000	58,830,000.00	6.05

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

5.8.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.8.3 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	375,695.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,548,689.21
5	应收申购款	53,174.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,977,558.70

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	59,421,318.00	6.11
2	113002	工行转债	30,628,784.00	3.15
3	113001	中行转债	28,596,337.20	2.94
4	126729	燕京转债	10,534,788.45	1.08
5	110011	歌华转债	1,431,769.50	0.15

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002610	爱康科技	24,012,500.00	2.47	网下新股申购锁定期

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	国投瑞银优化增强债券A/B	国投瑞银优化增强债券C
本报告期期初基金份额总额	1,006,205,198.23	453,277,052.05
本报告期基金总申购份额	128,650,877.77	501,889,902.40
减:本报告期基金总赎回份额	472,010,601.74	578,917,729.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	662,845,474.26	376,249,225.34

§7 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内基金管理人对本基金持有的因特殊事项而停牌的股票采用“指数收益法”进行估值调整。指定媒体公告时间为2011年9月29日。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

《关于国投瑞银优化增强债券型证券投资基金备案确认的函》(证监基金[2010]531号)
《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同》
《国投瑞银优化增强债券型证券投资基金托管协议》
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
国投瑞银优化增强债券型证券投资基金2011年第三季度报告原文

8.2 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

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
二〇一一年十月二十六日

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)

2011 第三季度 报告

2011年9月30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
报告送出日期:2011年10月26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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银中证消费服务指数(LOF)(场内简称:国投消费)	
基金主代码	161213	
交易代码	前端:161213	后端:161215
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年12月16日	
报告期末基金份额总额	706,919,864.66份	
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对中证下游消费与服务产业指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股或权重调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因市场因素影响或法律法规限制等特殊情况导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。 本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。	
业绩比较基准	业绩比较基准=95%×中证下游消费与服务产业指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、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	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年07月01日-2011年09月30日)
1.本期已实现收益	-17,127,530.51
2.本期利润	-68,792,157.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0915
4.期末基金资产净值	598,731,414.11
5.期末基金份额净值	0.847

注:1、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。

2、以上所述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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

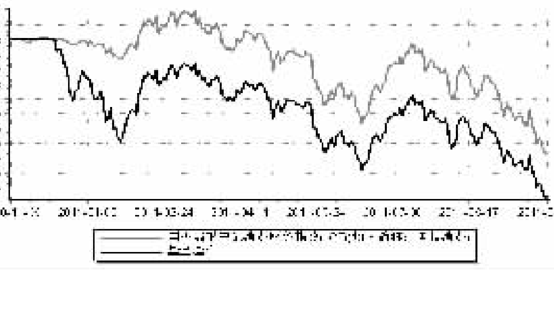
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-9.80%	1.15%	-9.59%	1.15%	-0.21%	0.00%

注:1、本基金是以中证下游消费与服务产业指数为标的指数的被动式、指数型基金,故以95%×中证下游消费与服务产业指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)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:1、本基金基金合同生效日为2010年12月16日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

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91.97%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例0%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例8.10%,符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
孟亮	本基金基金经理	2010年12月16日	-	6	中国籍,博士,具有基金从业资格。曾任职于上投摩根基金管理有限公司。2010年4月加入国投瑞银。现兼任国投瑞银沪深300金融地产指数基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)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 公平交易专项说明

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的说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年三季度,通胀达到全年最高点后回落缓慢,货币政策维持紧缩趋势不改。诸多宏观数据和微观调研均表明,由于持续调控,需求端面临的压力加大,经济增速放缓的态势逐步形成,引发投资者对企业盈利下调的担忧;另一方面,8月底央行要求商业银行将保证金存款纳入准备金缴纳范围,进一步加剧资金紧张的预期。国际方面,8月5日标普下调美国主权长期信用评级,欧债危机解决进程进展缓慢,引发全球资本市场动荡。三季度沪深300指数跌15.2%,中证下游指数跌10.1%。

基金投资操作上,作为指数基金,投资操作以严格控制跟踪误差为主,积极应对成分股调整、成分股替代停牌机会成本,同时也密切关注基金申购赎回及市场出现的结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.847元,本报告期份额净值增长率为-9.80%,同期业绩比较基准收益率为-9.59%,基金净值增长率落后于业绩基准收益率0.21%。主要原因在于成份股中百集团在报告期内长期停牌,自2011年9月28日起,本基金管理人按中证协SAC行业指数作为计算依据,对该股票采用“指数收益法”进行估值调整。该事项影响基金净值约-0.1%。此外成分股调整和申购赎回影响也对基金净值有一定影响。报告期内,日均跟踪误差为0.0391%,年化跟踪误差为0.7795%,符合基金合同约定的跟踪误差不超过0.35%以及4.0%的限制。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	权益投资	550,656,705.06	91.79
	其中:股票	550,656,705.06	91.79
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	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	48,519,030.80	8.09
6	其他各项资产	732,659.08	0.12
7	合计	599,908,394.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,156,073.39	2.53
B	采掘业	-	-
C	制造业	335,315,069.40	56.00
C0	食品、饮料	137,289,397.63	22.93
C1	纺织、服装、皮毛	13,112,416.53	2.19
C2	木材、家具	1,995,525.66	0.33
C3	造纸、印刷	1,566,437.55	0.26
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	13,124,922.25	2.19
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	66,181,482.35	11.05
C8	医药、生物制品	102,044,887.43	17.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,160,218.40	0.53
F	交通运输、仓储业	61,593,907.59	10.29
G	信息技术业	37,188,401.46	6.21
H	批发和零售贸易	52,261,073.09	8.73
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	18,051,680.70	3.01
L	传播与文化产业	9,609,733.33	1.61
M	综合类	18,320,547.70	3.06
	合计	550,656,705.06	91.97

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	145,115	27,657,467.85	4.62
2	000858	五粮液	663,405	24,081,601.50	4.02
3	002024	苏宁电器	1,464,474	15,245,174.34	2.55
4	600050	中国联通	2,958,122	15,145,584.64	2.53
5	601006	大秦铁路	2,078,564	14,903,303.88	2.49
6	000651	格力电器	692,241	13,837,897.59	2.31
7	002304	洋河股份	94,333	12,829,288.00	2.14
8	600104	上海汽车	802,510	12,824,109.80	2.14
9	600887	伊利股份	620,483	11,354,838.90	1.90
10	600518	康美药业	758,550	10,733,482.50	1.79

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券资产。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券资产。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券中,包括“五粮液”663,405股,市值2,408万元,占基金资产净值4.02%。根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月27日公告,由于该公司存在信息披露不及时、不完整行为,中国证监会对该公司以及公司相关责任人员依法实施了警告和罚款的处罚。基金管理人认为,该处罚有利于促进公司加强对信息披露工作的管理,进一步规范公司的治理结构,处罚对公司今年以来的经营活动没有产生实质性影响,未改变公司基本面,尚不足以影响基金的投资策略。

除上述情况外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.8.3 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	55,293.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,478.13
5	应收申购款	668,887.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	732,659.08

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	724,790,346.21
本报告期基金总申购份额	111,773,354.76
减:本报告期基金总赎回份额	129,643,836.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	706,919,864.66

§7 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内基金管理人对本基金持有的因特殊事项而停牌的股票采用“指数收益法”进行估值调整。指定媒体公告时间为2011年9月29日。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

《关于国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)备案确认的函》(基金部函[2010]758号)
《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)基金合同》
《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)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
国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)2011年第三季度报告原文

8.2 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

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
二〇一一年十月二十六日