

国投瑞银新兴混合型证券投资基金(LOF)

2013 第三季度报告

2013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:2013年10月23日
1.1 重要提示
基金管理人承诺:本基金管理人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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益 1,775,517.97
2.本期利润 8,544,822.25
3.加权平均基金份额本期利润 0.1199
4.期末基金份额净值 92,568,531.44

3.2 基金业绩表现
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对比
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 10.07% 1.33% 8.84% 0.83% 1.23% 0.70%

3.2.2 本基金合同生效以来本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
注:截至本报告期末本基金资产配置比例为:股票投资占基金净值比例74.54%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例3.09%,现金类资产比例19.37%,符合基金合同的有关规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 聘任日期 解任日期 证券从业年限 说明
马少敏 本基金基金经理 2011年12月13日 - 15 中国籍,硕士,具有基金从业资格,曾任于平安证券,现任国投瑞银新兴混合型证券投资基金(LOF)基金经理,兼任国投瑞银全球资产配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

5.1 报告期末基金资产组合情况
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 69,372,889.43 74.41
其中:股票 69,372,889.43 74.41
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 - -
3.1 国债投资 - -
3.2 央行票据 - -
3.3 金融债 - -
3.4 企业债 - -
3.5 可转债 - -
3.6 其他固定收益投资 - -
4 货币市场基金投资 - -
5 银行存款和结算备付金合计 - -
6 其他资产 - -
7 负债 - -

5.2 基金产品概况
国投瑞银新兴混合型证券投资基金(LOF)(场内简称:国投瑞银)
基金主代码:161217
交易所代码:161217
基金运作方式:上市型开放式
基金合同生效日:2011年07月21日
报告期末基金份额总额:330,978,044.49份

5.3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年07月01日至2013年09月30日)
1.本期已实现收益 -4,728,869.52
2.本期利润 11,239,707.47
3.加权平均基金份额本期利润 0.0345
4.期末基金份额净值 197,289,890.36
5.期末基金资产净值 197,289,890.36

5.4 管理人报告
5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 聘任日期 解任日期 证券从业年限 说明
刘伟 本基金基金经理 2011年07月21日 - 9 中国籍,硕士,具有基金从业资格,曾任于招商证券,现任国投瑞银新兴混合型证券投资基金(LOF)基金经理,兼任国投瑞银全球资产配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况
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 185,361,916.23 93.65
其中:股票 185,361,916.23 93.65
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 - -
4 货币市场基金投资 - -
5 银行存款和结算备付金合计 - -
6 其他资产 - -
7 负债 - -

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include A (农林、牧、渔), B (采矿业), C (制造业), D (电力、热力、燃气及生产供应业), E (建筑业), F (批发和零售业), G (交通运输、仓储和邮政业), H (住宿和餐饮业), I (信息传输、软件和信息技术服务业), J (金融业), K (房地产业), L (租赁和商务服务业), M (科学研究和技术服务业), N (水利、环境和公共设施管理业), O (居民服务、修理和其他服务业), P (教育), Q (卫生和社会工作), R (文化、体育和娱乐业), S (综合).

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 002236 大舜股份, 002411 爱康医疗, 002033 聚源股份, 002415 海康威视, 002653 药明康德, 300228 富源药业, 002038 双环股份, 300333 华荣股份, 300074 华谊股份.

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债, 2 央行票据, 3 金融债, 4 企业债, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债, 8 其他, 9 合计.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 110015 石化转债, 2 113002 工行转债.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收利息, 4 应收股利, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 110015 石化转债, 2 113002 工行转债.

5.6 开放式基金业务情况
5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.9 投资组合报告
5.9.1 权益投资
5.9.2 基金投资
5.9.3 固定收益投资
5.9.4 货币市场基金投资
5.9.5 银行存款和结算备付金
5.9.6 其他资产
5.9.7 负债

5.10 报告期末基金资产组合情况
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 185,361,916.23 93.65
其中:股票 185,361,916.23 93.65
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 - -
4 货币市场基金投资 - -
5 银行存款和结算备付金合计 - -
6 其他资产 - -
7 负债 - -

5.11 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年07月01日至2013年09月30日)
1.本期已实现收益 185,361,916.23
2.本期利润 185,361,916.23
3.加权平均基金份额本期利润 0.0345
4.期末基金份额净值 197,289,890.36
5.期末基金资产净值 197,289,890.36

5.12 基金产品概况
国投瑞银新兴混合型证券投资基金(LOF)(场内简称:国投瑞银)
基金主代码:161217
交易所代码:161217
基金运作方式:上市型开放式
基金合同生效日:2011年07月21日
报告期末基金份额总额:330,978,044.49份

国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金

2013 第三季度报告

2013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:2013年10月23日
1.1 重要提示
基金管理人承诺:本基金管理人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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益 1,628,474.36
2.本期利润 2,193,870.55
3.加权平均基金份额本期利润 0.0064
4.期末基金份额净值 213,864,396.00

3.2 基金业绩表现
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对比
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 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

3.2.2 本基金合同生效以来本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
注:截至本报告期末本基金资产配置比例为:股票投资,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期投资占基金净值比例73%,现金类资产比例27%,符合基金合同的有关规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 聘任日期 解任日期 证券从业年限 说明
李怡文 本基金基金经理 2011年12月20日 - 12 中国籍,芝加哥大学工商管理硕士,具有基金从业资格,曾任于招商证券,现任国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金(LOF)基金经理,兼任国投瑞银全球资产配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

5.1 报告期末基金资产组合情况
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 105,514,888.24 46.3
其中:股票 105,514,888.24 46.3
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 191,848,123.60 84.50
其中:国债 191,848,123.60 84.50
4 货币市场基金投资 - -
5 银行存款和结算备付金合计 210,149,440.00 88.5

5.2 基金产品概况
国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金
基金主代码:121010
交易所代码:121010
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年12月20日
报告期末基金份额总额:201,082,785.09份

5.3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益 1,628,474.36
2.本期利润 2,193,870.55
3.加权平均基金份额本期利润 0.0064
4.期末基金份额净值 213,864,396.00

5.4 管理人报告
5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 聘任日期 解任日期 证券从业年限 说明
刘伟 本基金基金经理 2011年07月21日 - 9 中国籍,硕士,具有基金从业资格,曾任于招商证券,现任国投瑞银新兴混合型证券投资基金(LOF)基金经理,兼任国投瑞银全球资产配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

5.5 投资组合报告
5.5.1 报告期末基金资产组合情况
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 185,361,916.23 93.65
其中:股票 185,361,916.23 93.65
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 - -
4 货币市场基金投资 - -
5 银行存款和结算备付金合计 - -
6 其他资产 - -
7 负债 - -

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include A (农林、牧、渔), B (采矿业), C (制造业), D (电力、热力、燃气及生产供应业), E (建筑业), F (批发和零售业), G (交通运输、仓储和邮政业), H (住宿和餐饮业), I (信息传输、软件和信息技术服务业), J (金融业), K (房地产业), L (租赁和商务服务业), M (科学研究和技术服务业), N (水利、环境和公共设施管理业), O (居民服务、修理和其他服务业), P (教育), Q (卫生和社会工作), R (文化、体育和娱乐业), S (综合).

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 002415 海康威视, 002653 药明康德, 300228 富源药业, 002038 双环股份, 300333 华荣股份, 300074 华谊股份.

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债, 2 央行票据, 3 金融债, 4 企业债, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债, 8 其他, 9 合计.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 110015 石化转债, 2 113002 工行转债.

Table with 5 columns: 序号, 名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收利息, 4 应收股利, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 113002 工行转债.

5.6 开放式基金业务情况
5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.9 投资组合报告
5.9.1 权益投资
5.9.2 基金投资
5.9.3 固定收益投资
5.9.4 货币市场基金投资
5.9.5 银行存款和结算备付金
5.9.6 其他资产
5.9.7 负债

5.10 报告期末基金资产组合情况
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 105,514,888.24 46.3
其中:股票 105,514,888.24 46.3
2 基金投资 - -
3 固定收益投资 191,848,123.60 84.50
其中:国债 191,848,123.60 84.50
4 货币市场基金投资 - -
5 银行存款和结算备付金合计 210,149,440.00 88.5

5.11 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年07月01日至2013年09月30日)
1.本期已实现收益 1,628,474.36
2.本期利润 2,193,870.55
3.加权平均基金份额本期利润 0.0064
4.期末基金份额净值 213,864,396.00

5.12 基金产品概况
国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金
基金主代码:121010
交易所代码:121010
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年12月20日
报告期末基金份额总额:201,082,785.09份

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)

2013 第三季度报告

2013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:2013年10月23日
1.1 重要提示
基金管理人承诺:本基金管理人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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年07月01日至2013年09月30日)
1.本期已实现收益 -4,728,869.52
2.本期利润 11,239,707.47
3.加权平均基金份额本期利润 0.0345
4.期末基金份额净值 197,289,890.36
5.期末基金资产净值 197,289,890.36

3.2 基金业绩表现
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对比
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 6.43% 1.71% 4.06% 1.74% 2.37% -0.03%

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益 1,628,474.36
2.本期利润 2,193,870.55
3.加权平均基金份额本期利润 0.0064
4.期末基金份额净值 213,864,396.00

3.2 基金业绩表现
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对比
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 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

3.2.2 本基金合同生效以来本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
注:截至本报告期末本基金资产配置比例为:股票投资,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期投资占基金净值比例73%,现金类资产比例27%,符合基金合同的有关规定。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益 1,628,474.36
2.本期利润 2,193,870.55
3.加权平均基金份额本期利润 0.0064
4.期末基金份额净值 213,864,396.00

3.2 基金业绩表现
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对比
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 0.95% 0.10% 1.08% 0.01% -0.13% 0.09%

3.2.2 本基金合同生效以来本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比
注:截至本报告期末本基金资产配置比例为:股票投资,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期投资占基金净值比例73%,现金类资产比例27%,符合基金合同的有关规定。

国投瑞银基金管理有限公司 二〇一三年十月二十三日

国投瑞银基金管理有限公司 二〇一三年十月二十三日