国投瑞银创新动力股票型证券投资基金

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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银创新动力股票
基金主代码	121005
交易代码	前端:121005 后端:128005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月15日
报告期末基金份额总额	3,459,708,844.10份
投资目标	通过投资主要以创新为驱动力的优质上市公司的股票,分享企业成长带来的超额回报,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验,根据中国市场的特点,采取积极的投资管理策略。 1.战略资产配置比例原则: (1)股票组合投资比例:60—95%; (2)股票以外的其他资产投资比例:5%—40%;其中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 股票投资决策以自下而上的公司基本面分析为主。 借鉴GEVS,以合适方法估计股票投资价值。构建及调整模拟组合,进行风险管理与归因分析。 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 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、持有或出出权证。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信标普全债指数×20%
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	中国光大银行股份有限公司

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	56,684,917.49
2.本期利润	291,867,066.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0788
4.期末基金资产净值	2,721,637,667.21
5.期末基金份额净值	0.7867

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

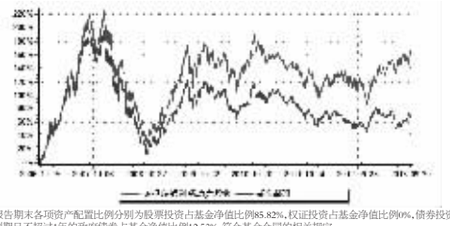
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.30%	1.45%	8.65%	1.12%	2.65%	0.33%

注:1、本基金属于股票型基金,一般情况下,股票投资的比例大约为基金资产的80%。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,具体业绩比较基准为中信标普300指数×80% +中信标普全债指数×20%。

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85.82%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例1.92%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例12.53%,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		
孟兜	本基金基金经理、基金投资部副总监	2013年6月15日	—	8	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,曾任国投瑞银消费服务指数基金(LOF)和国投瑞银沪深300金融地产指数基金(LOF)基金基金经理,现兼任国投瑞银新兴产业基金和国投瑞银融华债券基金基金经理。

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。证券从业的含义遵从行业协会《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《国投瑞银创新动力股票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 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,受宏观经济企稳影响,A股市场出现了较大幅度的反弹。市场风格方面,成长股开始出现分化,以金融股为代表的大盘蓝筹股开始不跑输成长股。除此之外,在改革预期下,自贸区、土地流转、国企改革等主题被投资者大幅追捧,主题性投资机会层出不穷。行业方面,信息服务、商业贸易、餐饮旅游表现领先,建筑建材、食品饮料、公用事业表现落后。

4.5 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0.7867元,本报告期份额净值增长率为11.30%,同期业绩比较基准收益率为8.65%。基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率,主要得益于精选个股的超额收益以及行业配置贡献。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,宏观经济的回暖,全年GDP完成7.5%的既定目标压力较小,政府赤字扩张的空间十分有限,预计四季度政府财政支出仍将保持平稳,货币政策由于存在美联储量化宽松政策退出的不确定性,央行可能会适度增加公开市场操作平抑流动性的变化,保持一定的灵活性,但是大幅宽松的空间有限。从市场角度看,在前三季度市场的赚钱效应带动下,场外投资者入市迹象有所呈现,未来一个阶段市场的各类投资热点预计还将在在或者不断涌现。本基金还将立足于企业的中长期成长,采用自下而上的方法不断挖掘优质个股和行业,力争为持有人创造合理回报。

§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	2,335,589,353.51	83.08
	其中:股票	2,335,589,353.51	83.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	52,184,169.00	1.86
	其中:债券	52,184,169.00	1.86
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	80,000,000.00	2.85
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	340,911,284.90	12.13
7	其他各项资产	2,436,565.72	0.09
8	合计	2,811,121,373.13	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,680,902,067.10	61.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	20,431,276.80	0.75
F	批发和零售业	161,246,976.07	5.92
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	168,413,894.52	6.19
J	金融业	—	—
K	房地产业	13,861,224.00	0.51
L	租赁和商务服务业	60,972,479.00	2.24
M	科学研究和技术服务业	16,222,922.10	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	36,222,852.38	1.33
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	177,315,661.54	6.52
S	综合	—	—
	合计	2,335,589,353.51	85.82

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	002236	大华股份	3,946,623	179,887,076.34	6.61
2	002241	歌尔声学	3,842,144	162,445,848.32	5.97
3	002415	海康威视	4,640,470	122,508,408.00	4.50
4	002653	海思科	5,273,224	121,442,348.72	4.46
5	600436	片仔癀	903,458	110,989,815.30	4.08
6	300228	富瑞特装	1,131,202	87,769,963.18	3.22
7	300133	华策影视	2,029,742	82,184,253.58	3.02
8	000028	国药一致	1,889,518	79,510,917.44	2.92
9	000538	云南白药	656,619	76,863,820.14	2.82
10	002038	双鹭药业	1,372,733	76,667,138.05	2.82

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	52,184,169.00	1.92
8	其他	—	—
9	合计	52,184,169.00	1.92

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	113002	工行转债	239,580	26,552,651.40	0.98
2	110015	石化转债	261,840	25,631,517.60	0.94

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	2,103,547.09
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	205,569.67
5	应收申购款	127,448.96
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,436,565.72

5.10.4 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	113002	工行转债	26,552,651.40	0.98
2	110015	石化转债	25,631,517.60	0.94

5.10.5 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不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本期末投资托管行股票、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	3,672,067,112.28
本报告期基金总申购份额	308,364,182.93
减:本报告期基金总赎回份额	520,722,451.11
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,459,708,844.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未运用固有资金对本基金进行申购、赎回或者买卖基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内基金管理人对成立子公司国投瑞银资本管理有限公司进行公告,指定媒体公告时间为2013年8月17日。

2、报告期内基金管理人对本基金持有的招商地产(证券代码:000024)进行估值调整,指定媒体公告时间为2013年9月10日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于同意国投瑞银创新动力股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]189号)

《关于国投瑞银创新动力股票型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2006]283号)

《国投瑞银创新动力股票型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银创新动力股票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

国投瑞银创新动力股票型证券投资基金2013年第三季度报告原文

9.2 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.ubsdic.com

9.3 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
二〇一三年十月二十三日

国投瑞银成长优选股票型证券投资基金

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 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2013年10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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银成长优选股票
基金主代码	121008
交易代码	前端:121008 后端:128008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年1月10日
报告期末基金份额总额	1,798,604,468.91份
投资目标	通过投资高速成长及业务有良好前景的企业,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	采取积极的股票投资管理策略,借鉴瑞士银行环球资产管理公司投资管理经验,在辅助性的主动类别资产配置基础上,自下而上地精选优质成长上市公司的股票构建组合,力求实现基金资产的长期稳定增长,同时,通过严谨的风险控制管理流程,实现风险一收益的最佳配比。 1.类别资产配置 股票投资比例:60%-100%; 除股票资产以外的其他资产投资比例:0%-40%,其中,权证投资占基金资产净值的比例不高于3%。投资于沪深300 指数成分股不低于股票资产的80%。 2.股票投资管理 股票投资决策是:以自下而上的公司基本面全面分析为主,挖掘优质成长企业,并使用GEVS 模型等方法评估股票的内在价值。构建股票组合的步骤是:确定股票初选库;基于公司基本面全面考量、筛选优质成长企业,运用GEVS 等估值方法,分析股票内在价值;结合风险管理,构建股票组合并对其进行动态调整。 3.债券投资管理 借鉴瑞士银行环球资产管理公司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。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	49,399,482.84
2.本期利润	136,449,358.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0739
4.期末基金资产净值	1,229,788,688.46
5.期末基金份额净值	0.6837

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

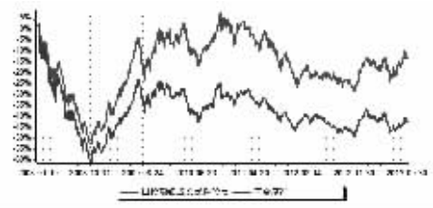
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.01%	1.26%	8.65%	1.12%	3.36%	0.14%

注:1、本基金属于股票型基金,在实际投资运作中,本基金将维持较高的股票投资比例,即股票资产在基金资产中的占比将以基金股票配置比例范围60-95%的中间值,即约80%为基准,根据股票、债券等类别资产的预期风险与预期收益的综合比较与判断进行调整,为此,综合基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金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,具体为80%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数。

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70.01%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例0.38%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例13.89%,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		
基峰鹏	本基金基金经理	2010年6月29日	—	10	中国籍,硕士,具有基金从业资格,曾任华林证券研究员、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,曾任国投瑞银核心企业基金基金经理。

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。证券从业的含义遵从行业协会《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《国投瑞银成长优选股票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 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,受宏观经济企稳影响,A股市场出现了较大幅度的反弹。市场风格方面,成长股开始出现分化,以金融股为代表的大盘蓝筹股开始不跑输成长股。除此之外,在改革预期下,自贸区、土地流转、国企改革等主题被投资者大幅追捧,主题性投资机会层出不穷。行业方面,信息服务、商业贸易、餐饮旅游表现领先,建筑建材、食品饮料、公用事业表现落后。

4.5 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0.6837元,本报告期份额净值增长率为12.01%,同期业绩比较基准收益率为8.65%。本基金本季度跑赢基准的主要原因是持有较多的在三季度表现较好的餐饮旅游股、银行股。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们对指数不悲观,但我们对以创业板为代表的成长股谨慎。在投资标的的选择上,我们认为下一个阶段价值股会胜出。理由在于,经过一年的上涨,太多的成长股透支了未来,即使投资者所期望的故事会部兑现,我们也看不到市值进一步上涨的空间。反过来,"新兴"行业高估值对应的是很多传统行业被打上了"过气"的标签,但事实上很多行业龙头公司的核心竞争力并没有被"新兴"公司侵蚀,行业也远远没到濒临消失的底部,接下来我们会继续持有低估值、行业基本面稳定的大盘蓝筹股,如保险、地产,另外,我们会遵循国企改革主线选择有潜力的品种加大配置。

§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	860,926,272.06	69.78
	其中:股票	860,926,272.06	69.78
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,689,752.50	0.38
	其中:债券	4,689,752.50	0.38
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	173,757,504.88	14.08
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	170,834,150.79	13.85
7	其他各项资产	23,562,952.72	1.91
8	合计	1,233,770,632.95	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	13,905,000.00	1.13
B	采矿业	—	—
C	制造业	189,798,895.72	15.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,003,733.81	1.22
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	110,504,720.36	8.99
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	115,144,393.50	9.36
K	房地产业	252,535,016.27	20.53
L	租赁和商务服务业	81,018,953.14	6.59
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	78,149,309.16	6.35
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	4,866,250.10	0.40
S	综合	—	—
	合计	860,926,272.06	70.01

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	601318	中国平安	1,799,955	64,258,393.50	5.23
2	000002	万 科A	6,600,000	60,258,000.00	4.90
3	600724	宁波富达	10,100,000	45,046,000.00	3.66
4	600138	中青旅	2,599,913	43,730,536.66	3.56
5	000024	招商地产	1,699,866	40,796,784.00	3.32
6	000888	峨眉山A	2,289,068	37,929,856.76	3.08
7	601888	中国国旅	899,817	37,288,416.48	3.03
8	600837	海通证券	2,600,000	32,526,000.00	2.64
9	600223	鲁商置业	6,722,271	29,712,437.82	2.42
10	000028	国药一致	699,752	29,445,564.16	2.39

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	4,442,500.00	0.36
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	247,252.50	0.02
8	其他	—	—
9	合计	4,689,752.50	0.38

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	126018	08江铜债	50,000	4,442,500.00	0.36
2	110022	同仁转债	1,850	247,252.50	0.02

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券中,包括"中国平安"1,799,955股,市值6,426万元,占基金资产净值5.23%;根据中国平安保险(集团)股份有限公司2013年5月21日公告,该集团控股子公司"平安证券有限责任公司"收到中国证券监督管理委员会《行政处罚和市场禁入事先告知书》,决定对平安证券有限责任公司给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。2012年,平安证券投行业务承销佣金收入占该集团营业收入的0.19%,投行业务利润占该集团净利润的0.66%。基金管理人认为,本处罚对该集团经营活动没有产生实质性影响,未改变该集团基本面,本基金对该股票的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	670,713.90
2	应收证券清算款	22,553,316.29
3	应收股利	—
4	应收利息	92,175.72
5	应收申购款	246,746.81
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	23,562,952.72

5.10.4 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	110022	同仁转债	247,252.50	0.02

5.10.5 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不存在流通受限的情况。

5.10.6 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	1,873,878,687.89
本报告期基金总申购份额	10,860,970.83
减:本报告期基金总赎回份额	86,135,189.81
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,798,604,468.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未运用固有资金对本基金进行申购、赎回或者买卖基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内基金管理人对成立子公司国投瑞银资本管理有限公司进行公告,指定媒体公告时间为2013年8月17日。

2、报告期内基金管理人对本基金持有的招商地产(证券代码:000024)进行估值调整,指定媒体公告时间为2013年9月10日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于核准融鑫证券投资基金基金份额持有大会决议的批复》(证监基金字[2007]344号)

《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银成长优选股票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

国投瑞银成长优选股票型证券投资基金2013年第三季度报告原文

9.2 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.ubsdic.com

9.3 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
二〇一三年十月二十三日

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)

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 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2013年10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2013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	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2010年12月16日	
报告期末基金份额总额	491,635,271.32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	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(2013年07月01日-2013年09月