国投瑞银成长优选股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年3月31日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。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2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	1,726,038,368.23
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	本基金将采取积极的股票投资管理策略,借鉴UBSGlobal AM (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-收益的最佳配比。 1、类别资产配置本基金以"自下而上"的股票精选为主,并通过适度调整类别资产的配置比例,减少基金的系统性风险 本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险比较判别,对股票、债券和货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的适度平衡。此外,本基金还将利用基金管理人在长期投资管理过程中所积累的经验,根据市场突发事件、市场非有效例外效应等所形成的市场波动做战术性资产 配置调整。 2、股票投资管理本基金的股票投资决策 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。 3、债券投资管理 本基金借鉴UBS Global AM (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。 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、持有或沽出权证。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	赵会军
	联系电话	400-880-6868	010-66105799
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	130,430,921.44	-218,768,634.33	-243,481,705.71
本期利润	95,718,613.29	65,085,024.43	-622,565,351.72
加权平均基金份额本期利润	0.0513	0.0261	-0.1928
本期基金份额净值增长率	7.86%	3.96%	-23.38%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0611	-0.1289	-0.0471
期末基金资产净值	1,186,440,372.69	1,273,333,135.33	1,991,676,241.75
期末基金份额净值	0.6874	0.6373	0.6130

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、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、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(例如封闭式基金交易佣金、开 放式基金申购赎回费或基金转换费等等),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

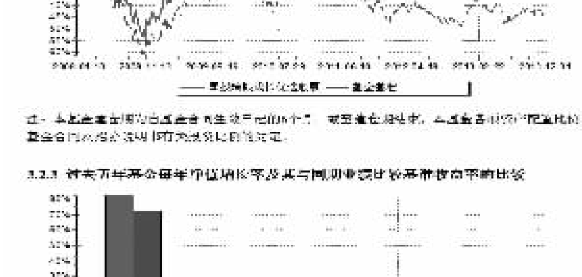
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.54%	0.88%	-2.75%	0.91%	3.29%	-0.03%
过去六个月	12.61%	1.09%	5.67%	1.02%	6.94%	0.07%
过去一年	7.86%	1.13%	-3.72%	1.10%	11.58%	0.03%
过去三年	-14.08%	1.07%	-17.90%	1.05%	3.82%	0.02%
过去五年	63.03%	1.24%	29.77%	1.23%	33.26%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-12.71%	1.40%	-43.80%	1.50%	31.09%	-0.10%

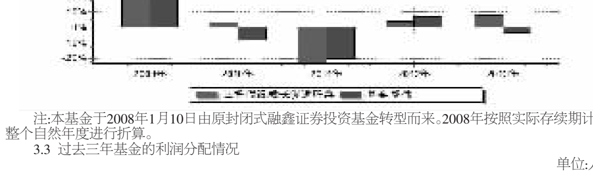
注:1、本基金属于股票型基金。在实际投资运作中,本基金将维持较高的股票投资比例,即股票资产在基金资产中的占比将以基金股票配置比例范围60-95%的中间值,即约80%为基准,根据股票、债券等类别资产的预期风险与预期收益的综合比较与判断进行调整,为此,综合基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金选用市场代表性较好的中信标普300指数和中信标普全债指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为80%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数。

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金于2008年1月10日由原封闭式融鑫证券投资基金转型而来。2008年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	1.500	369,631,829.74	121,755,374.67	491,387,204.41	
合计	1.500	369,631,829.74	121,755,374.67	491,387,204.41	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司(简称"公司"),原中融基金管理有限公司,经中国证券监督管理委员会批准,于2002年6月13日正式成立,注册资本1亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司,公司股东为国投信托有限公司(国家开发投资公司的全资子公司)及瑞士银行股份有限公司(UBS AG)。公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效的风险管理及控制架构,以"诚信、客户关注、包容性、社会责任"作为公司的企业文化。截止2013年12月底,公司有员工145人,其中88人具有硕士或博士学位;公司管理23只基金,其中包括2只创新型分级基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
綦缚鹏	本基金基金经理	2010年6月29日	-	11	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。
刘钦	本基金基金经理助理、高级研究员	2011年11月18日	-	10	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任职于国信证券、国信弘盛投资有限公司。2011年5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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度,并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则:

1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时,坚持基金持有人利益优先;

2、当不同资产委托人利益发生冲突时,应公平的对待不同的资产委托人;

3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合;

4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下:

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程,提高投资管理的科学性和客观性,确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动,同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系,加强交易分配的内部控制,通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现,同时通过监察稽核,事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下:

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统,充分发挥系统的自动控制功能,根据公平交易管理的要求,在系统中设置相应业务流转顺序、控制阀值或者触发机制,对触及阀值的行为视情况分别采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务自动执行必要的后续流程。如:符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易,内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理,控制阀值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动,通过建立明确的业务规则和流程,在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制,通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求,实现对关键业务风险的管理。如:以公司名义进行的一级市场申购结果分配,需要经过严格的公平性审核,由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后才为有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位,分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控,并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况,监督督促公平交易制度的执行。如:交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督,监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核,监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析,发现控制薄弱环节或交易价差异常,将重新检查公司投资决策和交易执行环节的内部控制,针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中,披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明,接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查,公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时,将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况,并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题,也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式,也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析,并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为,将依法采取相关监管措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现,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,形成了有效地公平交易体系。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。

报告期内,管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下:

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析,对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行T检验,检验在95%的可信水平下,价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较,区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况,

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算,检查在过去四个季度内,是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示,公司管理的所有投资组合,在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 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%的交易情况。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年,实体经济持续在低位运行,改革和转型成为A股市场的投资主线。在这样的背景下,A股市场呈现出了显著的结构化特征。以沪深300为主的大盘蓝筹股被视为"传统"经济的代表,估值被不断压缩。与之对应,以创业板为代表的小盘成长股被视为"新经济"的代表,受投资者持续追捧,创业板指数不断创出新高。

本基金在2013年初,持有较多的医药、消费和电子类股票,但年中就逐渐退出了这些股票,转而买入低估值的大盘蓝筹股。

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0.6874元,本报告期份额净值增长率为7.86%,同期业绩比较基准收益率为-3.72%,基金份额净值增长率高于业绩比较基准。主要原因在于本基金在2013年大幅低配了沪深300为代表的大盘蓝筹股。

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2013年,我们认为A股市场的总体环境好于2012年,主要表现为以下几点:首先实体经济开始企稳反弹,尽管力度较弱但远远好于2012年的快速下滑;其次,在经展望2014年,我们的主要观点如下:实体经济难有起色,但继续大幅下滑的概率不大,实体经济的低迷在大盘蓝筹股上已经得到充分反应。流动性会持续偏紧,但不会更紧,在房地产和实体经济缺乏机会的情况下,股票市场只要有起色,流动性不是问题。2013年大盘蓝筹股与中小市值股票的背离大概率会被纠正。大盘蓝筹股或许难以上涨,但估值已经被极度压缩。成长股估值扩张过度,存在休整的需要,引发成长股估值调整的因素就是IPO的重启。综上所述,我们对2014年A股市场持中性态度,蓝筹股虽然便宜,但目前无法看到系统上涨的刺激因素,成长股由于估值过高,投资机会只能是局部的。

在投资标的选择方面,我们目前倾向于用低估值的股票来做底仓,而对应成长股我们会提高选股的标准,看好消费、医药,以及自下而上的选择那些确实有核心竞争力的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估,并对基金估值程序进 行监督;估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等 事项,估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以 及监察稽核部指定人员;运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策, 设立基金估值核算员岗负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关成员均具有相应 的专业胜任能力和相关工作经历。

本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果, 并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基 金经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职 业敏感,向估值小组提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的 证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管 行沟通,在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与 外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为130,430,921.44元,期末可供分配利润为-105,442,453.22元。

本基金本期末实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013年,本基金托管人在对国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013年,国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银成长优选股票型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

经普华永道中天会计师事务所审计,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正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国投瑞银成长优选股票型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		135,315,924.78	125,359,643.33
结算备付金		3,323,485.05	1,799,284.44
存出保证金		665,055.49	1,634,835.84
交易性金融资产		999,634,053.94	1,104,489,794.49
其中:股票投资		945,485,414.94	1,038,199,445.89
基金投资			
债券投资		54,148,639.00	66,290,348.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		58,570,279.36	67,830,461.75
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,018,263.87	390,591.05
应收股利		-	-
应收申购款		48,724.14	67,465.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,198,575,786.63	1,301,572,076.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,539,607.97	23,746,573.40
应付赎回款		792,047.45	219,428.09
应付管理人报酬		1,519,818.63	1,532,122.47
应付托管费		253,303.10	255,353.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,473,312.49	1,528,341.86
应交税费		10,000.00	10,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		547,324.30	947,121.79
负债合计		12,135,413.94	28,238,941.33
所有者权益:			
实收基金		787,289,276.32	911,362,085.87
未分配利润		399,151,096.37	361,971,049.46
所有者权益合计		1,186,440,372.69	1,273,333,135.33
负债和所有者权益总计		1,198,575,786.63	1,301,572,076.66

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6874元,基金份额总额1,726,038,368.23份。

7.2 利润表

会计主体:国投瑞银成长优选股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
一、收入		126,548,688.75	102,298,764.86
1.利息收入		4,433,456.22	6,463,628.68
其中:存款利息收入		1,563,389.93	1,974,761.47
债券利息收入		961,653.35	2,849,924.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,908,412.94	1,638,942.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		156,705,748.82	-188,222,674.29
其中:股票投资收益		142,214,492.52	-199,570,262.60
基金投资收益			
债券投资收益		4,134,935.47	455,293.24
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		10,356,320.83	10,892,295.07
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-34,712,308.15	283,853,658.76
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)			
5.其他收入(损失以"-"号填列)		121,791.86	204,151.71
减:二、费用		30,830,075.46	37,213,740.43
1.管理人报酬		18,597,774.26	23,022,714.42
2.托管费		3,099,629.05	3,837,118.91
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		8,690,578.84	9,914,970.30
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		442,093.31	438,936.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		95,718,613.29	65,085,024.43
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		95,718,613.29	65,085,024.43

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国投瑞银成长优选股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	911,362,085.87	361,971,049.46	1,273,333,135.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	95,718,613.29	95,718,613.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-124,072,809.55	-58,538,566.38	-182,611,375.93
其中:1.基金申购款	20,992,140.29	9,530,549.11	30,522,689.40
2.基金赎回款	-145,064,949.84	-68,069,115.49	-213,134,065.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	787,289,276.32	399,151,096.37	1,186,440,372.69
项 目	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,482,042,880.40	509,633,361.35	1,991,676,241.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	65,085,024.43	65,085,024.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-570,680,794.53	-212,747,336.32	-783,428,130.85
其中:1.基金申购款	27,494,757.42	9,305,666.34	36,800,423.76
2.基金赎回款	-598,175,551.95	-222,053,002.66	-820,228,554.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	911,362,085.87	361,971,049.46	1,273,333,135.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘纯亮	刘纯亮	冯伟
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国投瑞银成长优选股票型证券投资基金是根据原融鑫证券投资基金(以下简称"基金融鑫")基金份额持有人大会2007年12月17日审议通过的《关于融鑫证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2007]344号《关于核准融鑫证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,由原基金融鑫转型而来。原基金融鑫为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称"深交所")交易上市,存续期限至2008年2月止。根据深交所深证复[2008]1号《关于同意融鑫证券投资基金终止上市的批复》,原基金融鑫于2008年1月9日进行终止上市权利登记。自2008年1月10日起,原基金融鑫终止上市,原基金融鑫更名为国投瑞银成长优选股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),《融鑫证券投资基金基金合同》失效的同时《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金融鑫于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为1,868,797,783.97元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原融鑫证券投资基金份额拆分结果的公告》,本基金于2008年2月4日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:2.192338913,并于2008年2月13日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自2008年1月11日至2008年2月1日止期间内开放集中申购,共募集人民币2,871,783,866.07元,其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计人民币1,524,885.15元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第012号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2008年2月4日基金份额拆分后的基金份额净值1.0000元折合为2,871,783,866.07份基金份额,其中集中申购资金利息折合1,524,885.15份基金份额,并于2008年2月13日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票和债券,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%,债券投资占基金资产的比例为0-40%,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%。本基金的业绩比较基准为:80%×中信标普300 指数 + 20%×中信标普全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司于2014年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本期采用的会计政策、会计估计与上年度可比期间相一致。

7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
国投信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东
国投瑞银资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
国投瑞银资本管理有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,597,774.26	23,022,714.42
其中:支付销售机构的客户维护费	3,724,114.83	3,593,598.69

注:支付基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,099,629.05	3,837,118.91

注:支付基金托管人 中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
期初持有的基金份额	25,000,000.00	25,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	25,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	25,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.25%

注:基金管理人国投瑞银基金管理有限公司在本年度赎回本基金的交易通过国投瑞银基金管理有限公司直销办理,适用费率为0%。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	135,315,924.78	1,507,477.36	125,359,643.33	1,918,062.50

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000625	长安汽车	2013-12-31	公告重大事项	11.45	2014-01-03	11.72	1,037,300	12,060,016.92	11,877,085.00

注:本基金截至2013年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为938,196,968.94元,属于第二层级的余额为61,437,085.00 元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级999,027,132.69元,第二层级105,462,661.80元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	945,485,414.94	78.88
	其中:股票	945,485,414.94	78.88
2	固定收益投资	54,148,639.00	4.52
	其中:债券	54,148,639.00	4.52
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	58,570,279.36	4.89
	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	138,639,409.83	11.57
6	其他各项资产	1,732,043.50	0.14
7	合计	1,198,575,786.63	100.00

8.2 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	407,911,710.25	34.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,152,159.25	1.02
E	建筑业	20,175,832.20	1.70
F	批发和零售业	74,867,827.72	6.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	19,405,730.88	1.64
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	107,269,519.90	9.04
K	房地产业	212,408,587.59	17.90
L	租赁和商务服务业	54,331,467.06	4.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,375,182.25	2.48
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	7,587,397.84	0.64
S	综合	-	-
	合计	945,485,414.94	79.69

8.3 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	000002	万 科A	7,600,000	61,028,000.00	5.14
2	601318	中国平安	1,399,955	58,420,122.15	4.92
3	600525	长园集团	4,603,028	40,736,797.80	3.43
4	000024	招商地产	1,899,866	39,479,215.48	3.33
5	600030	中信证券	2,870,541	36,599,397.75	3.08
6	600048	保利地产	4,386,700	36,190,275.00	3.05
7	600261	阳光照明	2,235,309	31,048,442.01	2.62
8	600019	宝钢股份	7,344,681	30,039,745.29	2.53
9	601888	中国国旅	850,000	29,665,000.00	2.50
10	000888	峨眉山A	1,487,351	29,375,182.25	2.48

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	114,556,138.91	9.00
2	600837	海通证券	85,059,422.82	6.68
3	000157	中联重科	76,727,465.06	6.03
4	600724	宁波富达	69,789,355.48	5.48
5	000024	招商地产	68,569,272.56	5.39
6	600030	中信证券	61,892,128.36	4.86
7	601318	中国平安	60,614,399.41	4.76
8	600036	招商银行	60,348,201.85	4.74
9	002146	荣盛发展	59,474,048.75	4.67
10	000888	峨眉山A	53,576,571.83	4.21
11	000876	新 希 望	49,006,731.82	3.85
12	600138	中青旅	48,410,321.66	3.80
13	002439	启明星辰	47,308,368.66	3.72
14	600376	首开股份	47,085,027.80	3.70
15	000002	万 科A	46,864,849.82	3.68
16	600031	三一重工	44,949,477.78	3.53
17	601688	华泰证券	41,334,503.94	3.25
18	600104	上汽集团	40,827,812.42	3.21
19	600048	保利地产	38,420,851.46	3.02
20	600525	长园集团	36,618,782.75	2.88
21	002024	苏宁云商	36,536,219.54	2.87
22	002638	勤上光电	35,235,173.01	2.77
23	000590	紫光古汉	34,456,146.63	2.71
24	600223	鲁商置业	34,408,303.11	2.70
25	600261	阳光照明	34,127,201.66	2.68
26	600016	民生银行	32,584,974.00	2.56
27	600011	华能国际	31,477,739.91	2.47
28	300232	洲明科技	31,379,365.33	2.46
29	600019	宝钢股份	30,766,997.67	2.42
30	000961	中南建设	28,689,315.03	2.25
31	300121	阳谷华泰	28,409,767.81	2.23
32	600754	锦江股份	27,184,109.85	2.13
33	600887	伊利股份	27,099,756.62	2.13
34	000069	华侨城A	26,840,757.74	2.11
35	601669	中国电建	26,824,064.00	2.11
36	600633	浙报传媒	26,345,300.35	2.07
37	601888	中国国旅	26,204,907.96	2.06
38	600969	郴电国际	25,857,433.27	2.03
39	600108	亚盛集团	25,789,700.85	2.03
40	000430	张家界	25,666,893.44	2.02
41	600993	马应龙	25,639,655.82	2.01
42	600266	北京城建	25,629,157.38	2.01

注: "买入金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	134,861,535.00	10.59
2	600594	益佰制药	122,698,158.32	9.64
3	600724	宁波富达	119,805,474.92	9.41
4	000157	中联重科	104,027,771.71	8.17
5	600837	海通证券	101,102,713.86	7.94
6	002345	潮宏基	62,236,423.41	4.89
7	600036	招商银行	60,322,303.12	4.74
8	002146	荣盛发展	54,298,560.79	4.26
9	600079	人福医药	49,055,974.79	3.85
10	600031	三一重工	46,469,552.55	3.65
11	002439	启明星辰	45,734,804.29	3.59
12	601688	华泰证券	41,369,323.80	3.25
13	600754	锦江股份	40,374,261.15	3.17
14	000069	华侨城A	39,768,731.24	3.12
15	000999	华润三九	39,714,320.76	3.12
16	002638	勤上光电	39,584,596.78	3.11
17	002024	苏宁云商	39,277,816.80	3.08
18	000590	紫光古汉	38,977,241.33	3.06
19	601888	中国国旅	37,291,377.42	2.93
20	600108	亚盛集团	36,518,578.97	2.87
21	600763	通策医疗	36,168,873.24	2.84
22	600138	中青旅	33,352,700.92	2.62
23	300083	劲胜股份	33,215,165.74	2.61
24	601939	建设银行	32,475,455.12	2.55
25	601318	中国平安	32,403,014.82	2.54
26	600016	民生银行	31,548,746.00	2.48
27	600011	华能国际	31,220,164.86	2.45
28	000026	飞亚达A	30,636,945.48	2.41
29	000876	新 希 望	29,810,469.59	2.34
30	601628	中国人寿	29,613,195.78	2.33
31	000709	河北钢铁	29,547,477.17	2.32
32	000028	国药一致	29,425,885.27	2.31
33	600546	山煤国际	28,978,490.43	2.28
34	000625	长安汽车	28,017,532.53	2.20
35	000888	峨眉山A	27,202,108.11	2.14
36	000059	辽通化工	27,000,235.69	2.12
37	300121	阳谷华泰	25,633,180.10	2.01
38	000961	中南建设	25,542,922.92	2.01

注: "卖出金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,717,532,147.71
卖出股票的收入(成交)总额	2,917,768,572.94

注: "买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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	49,560,000.00	4.18
	其中:政策性金融债	49,560,000.00	4.18
4	企业债券	4,357,500.00	0.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	231,139.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	54,148,639.00	4.56

8.6 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	120409	12农发09	500,000	49,560,000.00	4.18
2	126018	08江铜债	50,000	4,357,500.00	0.37
3	110022	同仁转债	1,850	231,139.00	0.02

8.7 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

本基金本期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本期末未持有权证。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1本基金投资的前十名证券中,包括"中国平安"1,399,955 股,市值5,842万元,占基金资产净值4.92%;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。

8.11.2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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	665,055.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,018,263.87
5	应收申购款	48,724.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,732,043.50

8.11.4 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	231,139.00	0.02

8.11.5 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中不存在流通受限的情况。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
70,815	24,373.91	5,788,468.05	0.34%	1,720,249,900.18	99.66%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	125,016.81	0.01%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含)。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年1月10日)基金份额总额	800,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,998,053,074.12
本报告期基金总申购份额	46,022,650.06
减:本报告期基金总赎回份额	318,037,355.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,726,038,368.23

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动如下:

自2013年2月21日起,包爱丽女士转任公司副总经理,不再担任督察长;由刘凯先生担任公司督察长。

自2013年3月29日起路博先生不再担任公司副总经理,由王书鹏先生接任。

自2013年5月2日起刘纯亮先生正式担任公司总经理。

上述人事变动均已按法律法规要求在指定媒体予以披露。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所,普华永道中天会计师事务所已为本基金连续提供审计服务6年。报告期内应支付给该事务所的报酬为100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东莞证券	1	1,860,549,933.46	33.02%	1,693,837.34	33.15%	
高华证券	1	1,016,758,305.66	18.04%	917,172.69	17.95%	
国信证券	1	848,587,722.75	15.06%	769,014.83	15.05%	
招商证券	1	568,763,202.31	10.09%	517,800.91	10.13%	
广发证券	1	418,344,634.29	7.42%	379,099.40	7.42%	
光大证券	1	391,633,976.02	6.95%	349,477.10	6.84%	
国泰君安	1	248,940,691.71	4.42%	226,634.86	4.44%	
中金公司	1	184,189,909.74	3.27%	167,686.91	3.28%	
宏源证券	1	97,532,344.71	1.73%	88,792.95	1.74%	

注:1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准,由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权,由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期未发生交易所回购及权证交易。

3、除上表列示租用证券公司交易单元外,本基金本报告期延续租用红塔证券1个交易单元,并退租民生证券、第一创业证券及信达证券各1个交易单元。上述租用证券公司交易单元本期均未发生交易量。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易	
	成交金额	占债券成交总额比例
东莞证券	40,369,909.10	45.45%
招商证券	10,374,771.45	11.68%
国泰君安	38,079,168.60	42.87%

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日