

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
送出日期:2013年3月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人承诺,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的法律责任。本年度报告已经本基金独立董事签字同意,并由董事长签发。
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2013年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值数据、利润分配情况、财务会计报告、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,也不保证基金份额持有人不受损失。
本年度报告摘要自公告之日起,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本年度报告自2012年1月1日起至12月31日止。

2012 年度报告摘要

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金

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
送出日期:2013年3月27日

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	000527	美的电器	1,570,297	15,169,069.02	2.70
2	300016	北陆药业	469,901	7,001,524.90	1.25
3	000347	普华永道	329,989	6,678,977.36	1.19
4	000273	联环药业	872,300	6,594,588.00	1.18
5	600026	宇通客车	258,000	6,501,600.00	1.16
6	600067	通化东宝	572,800	5,441,600.00	0.97
7	000869	华侨城A	649,938	4,744,535.00	0.87
8	300259	航天科技	239,700	3,032,205.00	0.54
9	300136	信天国际	108,096	1,738,455.00	0.31
10	000236	大华股份	11,217	519,907.95	0.09

§ 2 基金基本情况

基金名称:国投瑞银优化增强债券型证券投资基金
基金代码:121012
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年09月08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
报告期末基金份额总额:551,001,288.13份
基金合同存续期:不定期
下属分级基金的基本情况:
国投瑞银优化增强债券A/B 国投瑞银优化增强债券C
下属分级基金的交易代码:
121012(前两位)/128012(后两位) 128112
报告期末下属分级基金的份额总额:
550,329,517.57份 200,771,770.56份

§ 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

项目	2012年	2011年	2010年09月08日至2010年12月31日
本期已实现收益	8,946,599.49	-22,066,624.60	8,162,492.54
本期利润	30,893,586.59	-49,135,245.19	10,342,396.55
加权平均基金份额本期利润	0.0646	-0.0517	0.0076
期末基金份额净值	1.0088	0.9878	1.0000
期末可供分配基金份额利润	-0.0009	-0.0420	0.0031
期末基金资产净值	357,735,113.85	590,835,618.19	1,381,789,665.74
期末基金份额净值	1.0088	0.9878	1.0000

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	600276	恒瑞医药	33,511,158.48	3,666,232.00	1.03
2	000527	美的电器	27,292,809.46	2,744,000.00	0.77
3	000244	浙江广厦	25,133,412.06	2,744,000.00	0.77
4	000656	华利股份	20,158,749.77	2,744,000.00	0.77
5	000069	华侨城A	13,620,444.60	1,499,000.00	0.42
6	600036	招商银行	13,374,804.02	1,499,000.00	0.42
7	600199	中信海洋	12,748,628.84	1,499,000.00	0.42
8	600739	辽宁成大	12,900,103.88	1,499,000.00	0.42
9	600376	首开股份	11,139,816.71	1,499,000.00	0.42
10	601628	中国人寿	11,584,762.68	1,499,000.00	0.42
11	000226	福耀玻璃	44,530,291.07	1,266,000.00	0.35
12	600266	宇通客车	9,495,921.30	1,266,000.00	0.35
13	600867	通化东宝	9,403,613.35	1,266,000.00	0.35
14	000616	亿诚股份	9,041,101.60	1,266,000.00	0.35
15	601318	中国平安	8,804,076.00	1,266,000.00	0.35
16	601992	金隅股份	1,173,309.00	1,266,000.00	0.35
17	000625	长安汽车	7,656,192.00	1,266,000.00	0.35
18	600467	好当家	7,527,158.71	1,266,000.00	0.35
19	000002	万科A	7,557,683.42	1,266,000.00	0.35
20	601088	中国神华	7,299,019.12	1,266,000.00	0.35

3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

3.3 基金资产配置策略
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。

3.4 基金管理人及基金托管人

姓名	基金管理人	基金托管人
姓名	国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
联系电话	400-880-6868	010-6759-5906
电子邮箱	service@ubsic.com	tianjiang_ld@cb.com
客户服务电话	400-880-6868	010-6759-5906
传真	0755-82004438	010-6627-5865

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	600276	恒瑞医药	44,630,079.64	4,877,000.00	1.38
2	600887	伊利股份	39,640,979.71	4,327,000.00	1.25
3	002646	普华永道	29,966,124.16	3,277,000.00	0.95
4	002244	浙江广厦	21,750,303.60	2,377,000.00	0.70
5	600062	华联三盈	19,609,765.97	2,144,000.00	0.62
6	000036	招商银行	16,111,876.56	1,766,000.00	0.51
7	601555	东吴证券	14,485,869.82	1,699,000.00	0.49
8	000656	华利股份	15,789,541.51	1,766,000.00	0.51
9	600739	辽宁成大	13,063,044.32	1,437,000.00	0.41
10	601919	中信海洋	11,536,716.17	1,266,000.00	0.36
11	600376	首开股份	11,184,677.06	1,266,000.00	0.36
12	002004	华邦股份	11,166,156.62	1,266,000.00	0.36
13	000069	华侨城A	11,126,502.70	1,266,000.00	0.36
14	000002	万科A	11,054,266.61	1,266,000.00	0.36
15	601628	中国人寿	11,052,722.00	1,266,000.00	0.36
16	000616	亿诚股份	9,982,055.39	1,266,000.00	0.36
17	601318	中国平安	9,666,144.28	1,266,000.00	0.36
18	000626	福耀玻璃	9,286,861.62	1,266,000.00	0.36
19	000625	长安汽车	8,249,216.05	1,266,000.00	0.36
20	000729	嘉应药业	8,053,414.22	1,266,000.00	0.36

3.5 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

3.6 基金资产配置策略
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。

3.7 基金管理人及基金托管人

姓名	基金管理人	基金托管人
姓名	国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
联系电话	400-880-6868	010-6759-5906
电子邮箱	service@ubsic.com	tianjiang_ld@cb.com
客户服务电话	400-880-6868	010-6759-5906
传真	0755-82004438	010-6627-5865

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	600276	恒瑞医药	44,630,079.64	4,877,000.00	1.38
2	600887	伊利股份	39,640,979.71	4,327,000.00	1.25
3	002646	普华永道	29,966,124.16	3,277,000.00	0.95
4	002244	浙江广厦	21,750,303.60	2,377,000.00	0.70
5	600062	华联三盈	19,609,765.97	2,144,000.00	0.62
6	000036	招商银行	16,111,876.56	1,766,000.00	0.51
7	601555	东吴证券	14,485,869.82	1,699,000.00	0.49
8	000656	华利股份	15,789,541.51	1,766,000.00	0.51
9	600739	辽宁成大	13,063,044.32	1,437,000.00	0.41
10	601919	中信海洋	11,536,716.17	1,266,000.00	0.36
11	600376	首开股份	11,184,677.06	1,266,000.00	0.36
12	002004	华邦股份	11,166,156.62	1,266,000.00	0.36
13	000069	华侨城A	11,126,502.70	1,266,000.00	0.36
14	000002	万科A	11,054,266.61	1,266,000.00	0.36
15	601628	中国人寿	11,052,722.00	1,266,000.00	0.36
16	000616	亿诚股份	9,982,055.39	1,266,000.00	0.36
17	601318	中国平安	9,666,144.28	1,266,000.00	0.36
18	000626	福耀玻璃	9,286,861.62	1,266,000.00	0.36
19	000625	长安汽车	8,249,216.05	1,266,000.00	0.36
20	000729	嘉应药业	8,053,414.22	1,266,000.00	0.36

3.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

3.9 基金资产配置策略
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。

3.10 基金管理人及基金托管人

姓名	基金管理人	基金托管人
姓名	国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
联系电话	400-880-6868	010-6759-5906
电子邮箱	service@ubsic.com	tianjiang_ld@cb.com
客户服务电话	400-880-6868	010-6759-5906
传真	0755-82004438	010-6627-5865

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	600276	恒瑞医药	44,630,079.64	4,877,000.00	1.38
2	600887	伊利股份	39,640,979.71	4,327,000.00	1.25
3	002646	普华永道	29,966,124.16	3,277,000.00	0.95
4	002244	浙江广厦	21,750,303.60	2,377,000.00	0.70
5	600062	华联三盈	19,609,765.97	2,144,000.00	0.62
6	000036	招商银行	16,111,876.56	1,766,000.00	0.51
7	601555	东吴证券	14,485,869.82	1,699,000.00	0.49
8	000656	华利股份	15,789,541.51	1,766,000.00	0.51
9	600739	辽宁成大	13,063,044.32	1,437,000.00	0.41
10	601919	中信海洋	11,536,716.17	1,266,000.00	0.36
11	600376	首开股份	11,184,677.06	1,266,000.00	0.36
12	002004	华邦股份	11,166,156.62	1,266,000.00	0.36
13	000069	华侨城A	11,126,502.70	1,266,000.00	0.36
14	000002	万科A	11,054,266.61	1,266,000.00	0.36
15	601628	中国人寿	11,052,722.00	1,266,000.00	0.36
16	000616	亿诚股份	9,982,055.39	1,266,000.00	0.36
17	601318	中国平安	9,666,144.28	1,266,000.00	0.36
18	000626	福耀玻璃	9,286,861.62	1,266,000.00	0.36
19	000625	长安汽车	8,249,216.05	1,266,000.00	0.36
20	000729	嘉应药业	8,053,414.22	1,266,000.00	0.36

3.11 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

3.12 基金资产配置策略
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。

3.13 基金管理人及基金托管人

姓名	基金管理人	基金托管人
姓名	国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
联系电话	400-880-6868	010-6759-5906
电子邮箱	service@ubsic.com	tianjiang_ld@cb.com
客户服务电话	400-880-6868	010-6759-5906
传真	0755-82004438	010-6627-5865

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	600276	恒瑞医药	44,630,079.64	4,877,000.00	1.38
2	600887	伊利股份	39,640,979.71	4,327,000.00	1.25
3	002646	普华永道	29,966,124.16	3,277,000.00	0.95
4	002244	浙江广厦	21,750,303.60	2,377,000.00	0.70
5	600062	华联三盈	19,609,765.97	2,144,000.00	0.62
6	000036	招商银行	16,111,876.56	1,766,000.00	0.51
7	601555	东吴证券	14,485,869.82	1,699,000.00	0.49
8	000656	华利股份	15,789,541.51	1,766,000.00	0.51
9	600739	辽宁成大	13,063,044.32	1,437,000.00	0.41
10	601919	中信海洋	11,536,716.17	1,266,000.00	0.36
11	600376	首开股份	11,184,677.06	1,266,000.00	0.36
12	002004	华邦股份	11,166,156.62	1,266,000.00	0.36
13	000069	华侨城A	11,126,502.70	1,266,000.00	0.36
14	000002	万科A	11,054,266.61	1,266,000.00	0.36
15	601628	中国人寿	11,052,722.00	1,266,000.00	0.36
16	000616	亿诚股份	9,982,055.39	1,266,000.00	0.36
17	601318	中国平安	9,666,144.28	1,266,000.00	0.36
18	000626	福耀玻璃	9,286,861.62	1,266,000.00	0.36
19	000625	长安汽车	8,249,216.05	1,266,000.00	0.36
20	000729	嘉应药业	8,053,414.22	1,266,000.00	0.36

3.14 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

3.15 基金资产配置策略
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。

3.16 基金管理人及基金托管人

姓名	基金管理人	基金托管人
姓名	国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
联系电话	400-880-6868	010-6759-5906
电子邮箱	service@ubsic.com	tianjiang_ld@cb.com
客户服务电话	400-880-6868	010-6759-5906
传真	0755-82004438	010-6627-5865

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	600276	恒瑞医药	44,630,079.64	4,877,000.00	1.38
2	600887	伊利股份	39,640,979.71	4,327,000.00	1.25
3					