

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8月24日

## § 1 重要提示及目录

1.1 重要提示  
基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认,并由董事长签发。  
基金管理人中投瑞银银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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、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。  
基金管理人对本基金的过往业绩不表示其未来表现。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。  
本年度报告摘要简要地半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。  
本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况  
基金简称 国投瑞银新兴产业混合(LOF)(场内简称:国投产业)  
基金代码 161219  
交易代码 前端:161219 后端:161220  
基金运作方式 上市契约型开放式  
基金合同期限 2011年12月13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  
报告期末基金资产总额 69,080,276,661元  
基金合同存续期 不定期  
基金上市的证券交易所 深圳证券交易所  
上市日期 2012年01月16日  
2.2 基金产品说明  
通过股票与债券等资产的合理配置,精选战略新兴产业及其他行业的优质企业进行投资,分享新兴产业发展前景带来的投资机会,在有效控制风险的前提下,力争为投资人带来长期的稳定收益。

投资目标 本基金将采取主动的资产配置策略,注重风险与收益的平衡。本基金将紧密关注银行类资产投资机会,精选战略新兴产业及其他行业的优质企业,将基金投资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。  
本基金类别资产配置比例遵循如下原则:  
(1)股票投资的资金比例30%-80%;  
(2)权证投资的资金比例不大于3%;  
(3)现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%。  
业绩比较基准 55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数

风险收益特征 本基金属于中高风险、中高收益的基金品种,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人  
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

信息披露 联系人姓名 刘凯  
联系电话 400-880-6868  
电子邮箱 service@ubssdc.com  
客户服务电话 400-880-6868  
传真 0755-82904048

2.4 信息披露方式  
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.ubssdc.com  
基金半年度报告披露地点 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)  
本期已实现收益 8,261,899.27  
本期利润 12,190,710.68  
加权平均基金份额本期利润 0.1295  
期末基金份额净值增长率 22.87%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)  
期末可供分配基金份额利润 0.0975  
期末基金资产净值 80,252,117.26  
期末基金份额净值增长率 1.162

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)减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,采用期末资产负责表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计入期间后实际利润水平将低于所列数字。

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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
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  
金额单位:人民币元

3.2.3 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.4 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  
金额单位:人民币元

3.2.5 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.5 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  
金额单位:人民币元

3.2.6 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.6 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  
金额单位:人民币元

3.2.7 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.7 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  
金额单位:人民币元

3.2.8 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.8 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  
金额单位:人民币元

3.2.9 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.9 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  
金额单位:人民币元

3.2.10 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.10 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  
金额单位:人民币元

3.2.11 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.12 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  
金额单位:人民币元

3.2.13 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45% 3.83% 0.89% 19.04% 0.56%  
过去一年 26.36% 1.20% 0.66% 0.81% 25.70% 0.39%  
自基金合同生效日起至今 37.98% 1.08% -1.26% 0.84% 39.24% 0.24%

注:1.本基金属于灵活配置型基金,在实际投资运作中,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据股票配置比例范围30-80%的中间值,即为55%为基准,根据股票、债券等资产类别的配置比例与风险收益的组合比例与与中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为55%×中证新兴产业指数+45%×中债总指数。  
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.14 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  
金额单位:人民币元

3.2.15 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  
金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(%) 基准收益率 增长率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-③ ②-④  
过去一个月 -3.65% 1.98% -9.15% 1.18% 5.50% 0.80%  
过去三个月 12.72% 1.59% -1.81% 0.92% 14.53% 0.67%  
过去六个月 22.87% 1.45%