

# 国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金

## 【2013】第三季度报告

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  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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情况等内容,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预示其未来业绩表现,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	国投瑞银稳健增长混合
基金代码	121006
交易代码	前端:121006 后端:128006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月11日
报告期末基金份额总额	2,085,157,071.57份

投资目标  
通过股票与债券等资产的合理配置,追求收益与风险的平衡,力求实现基金资产的长期稳定增值。

采取主动的类别资产配置策略,注重风险与收益的平衡。借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验,精选具有资源优势的优质上市公司股票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。

1.类别资产配置  
股票投资比例40%-80%,债券投资比例0%-60%,权证投资比例0%-2%,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  
以自上而下的公司基本面分析为主,挖掘具有资源优势的股价低上市公司股票,并运用GEVS 模型等方法评估股票的投资价值。

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.权证投资管理  
考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期溢价率和无风险收益率等因素,估计权证合理价值,根据权证合理价值与其市场价格间的长期期“价值差(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、持有或卖出权证。

中信标普300指数×60%+中信标普全债指数×40%

本基金为灵活配置型混合基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其长期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于纯股票型基金。

业绩比较基准  
本基金为灵活配置型混合基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其长期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于纯股票型基金。

风险收益特征  
本基金为灵活配置型混合基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其长期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于纯股票型基金。

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

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 -146,906,479.02

2.本期利润 254,546,588.07

3.加权平均基金份额本期利润 0.0964

4.期末基金资产净值 2,492,311,394.14

5.期末基金份额净值 1.241

注:截至本报告期末各期货品种公允价值分别为股票投资占基金净值比例76.3%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例19%,现金及到期日不超过14个月的政府债券占基金净值比例4.0%,符合基金合同约定的投资比例。

§4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中信标普300指数×60%+中信标普全债指数×40%。

§5 基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,907,301,727.02	71.66
1.1	其中:股票	1,907,301,727.02	71.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,916,755.40	2.93
3.1	其中:债券	77,916,755.40	2.93
4	资产支持证券	-	-
5	买入返售金融资产	227,366,406.05	8.54
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	440,740,179.01	16.56
7.1	其中:各项存款	8,184,855.56	0.31
7.2	其他各项资产	77,916,755.40	2.93
8	合计	2,661,509,926.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	29,741,852.00	1.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,039,806,526.34	41.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	21,546,000.00	0.86
F	批发和零售业	125,706,905.77	5.04
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	293,586,573.28	11.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	177,051,232.22	7.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	129,817,337.77	5.21
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	90,045,299.64	3.61
S	综合	-	-
合计		1,907,301,727.02	76.53

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

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	49,920,000.00	2.00
4	企业债券	49,920,000.00	2.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	27,996,755.40	1.12
8	其他	-	-
9	合计	77,916,755.40	3.13

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	110015	石化转债	26,984,357.40	1,012,398.00	0.04
2	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.7 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.8 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.9 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.10 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.11 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.12 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.13 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.14 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.15 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.16 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.17 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	4.20
6	603000	人民网	804,115	75,506,398.50	3.03
7	002236	大华股份	1,618,053	73,750,855.74	2.96
8	002024	苏宁云商	5,017,737	64,477,920.45	2.59
9	000800	一汽轿车	4,474,393	59,375,195.11	2.38
10	600566	洪城股份	3,371,652	54,317,313.72	2.18

5.18 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	111023	11国开03	500,000	49,920,000.00	2.00
2	110015	石化转债	275,660	26,984,357.40	1.08
3	110018	国电转债	9,300	1,012,398.00	0.04

5.19 报告期末前十名股票公允价值占基金资产净值比例大于1%的股票

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	002557	洽洽食品	6,791,729	151,591,391.28	6.08
2	002415	金隅股份	5,144,126	135,804,926.40	5.45
3	600138	中青旅	7,830,821	131,714,409.22	5.28
4	002376	新北洋	9,037,505	110,076,810.00	4.42
5	300070	碧水源	2,570,993	104,639,415.10	