

2012年4月21日 星期六

国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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:2012年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的内容的真实性、准确性、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2012年4月19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，复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售机构承诺以忠实信用、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未来表现。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摘要、基金产品资料概要、基金定期报告。

本报告告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金

基金主代码 121099

基金运作方式 契约型开放式基金

基金合同生效日 2007年7月17日

报告期末基金份额总额 6,000,332,876.63份

基金投资目标 分享中国经济繁荣带来的收益，分享中国证券市场成长收益，力求实现基金资产的长期增值保值。

基金投资策略 1.类资产配置：根据宏观经济形势分析，把握债市蓝筹股，并使用GEVS等量化方法对股票的估值进行分析，判断股票的走势，结合行业、运用GEVS等估值方法，分散股票内在价值，结合风险管理，构建股票组合并进行动态调整。
2.股票投资管理：借鉴IB Global AM确定性的投资方法，采取“自上而下”的债券分析方法，确定股票投资品种，并结合股票的走势进行投资。

业绩比较基准 基金净值增长率=沪深300指数收益率×60%+货币市场基金收益率×40%，其中，权证投资占基金净资产的比例不超过5%，投资于沪深300指数成分股不低于股票资产的80%。

风险收益特征 风险收益特征：股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金净值的涨跌幅度可能高于货币市场基金、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

下属两级基金的基金简称 国投瑞银瑞福进取封闭场内简称“瑞福进取”

下属两级基金的交易代码 121099 150000

报告期末基金的份额总额 2,999,836,635.63份

基金总资产净值 3,000,496,238.00元

§ 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(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.2 报告期主要财务指标

单位:人民币元

报告期主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.3 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.4 报告期主要财务指标

单位:人民币元

报告期主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.5 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.6 报告期主要财务指标

单位:人民币元

报告期主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.7 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.8 报告期主要财务指标

单位:人民币元

报告期主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.9 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.10 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.11 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。

3.12 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -247,639,127.72

2.本期利润 66,429,823.87

3.期初平均基金份额利润 0.00111

4.期末基金份额净值 3,831,304,374.55

5.期初基金份额净值 0.639

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95.44%，权证投资占基金净值比例0.01%，货币市场基金净值比例0.16%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.48%，符合基金合同的相关规定。