

序号	项目	金额	占基金 (%)
1	权益投资	1,257,462,643.98	66.03

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,257,462,643.98	66.03
	其中:股票	1,257,462,643.98	66.03
2	固定收益投资	95,371,500.00	5.01
	其中:债券	95,371,500.00	5.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	340,649,150.97	17.89
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	202,489,601.93	10.63
7	其他各项资产 <sup>①</sup>	8,531,056.87	0.45
合计		1,904,503,953.75	100.00

7	合计	1,904,503,953.75	100.00
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
			金额单位：人民币
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	采掘业	-	-
C	制造业	710,011,122.72	37.85
C0	食品、饮料	115,416,900.00	6.15
C1	纺织、服装、皮毛	19,360,000.00	1.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	49,374,200.18	2.63
C5	电子	38,036,827.61	2.03
C6	金属、非金属	78,092,147.40	4.16
C7	机械、设备、仪表	88,673,913.76	4.73
C8	医药、生物制品	267,424,522.59	14.26
C99	其他制造业	53,632,611.18	2.86
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	9,180,000.00	0.49

G	信息技术业	36,928,000.00	1.97
H	批发和零售贸易	237,742,914.28	12.67
I	金融、保险业	62,339,746.89	3.32
J	房地产业	82,824,000.00	4.41
K	社会服务业	87,199,354.75	4.65
L	传播与文化产业	31,237,505.34	1.67
M	综合类	-	-
	合计	1,257,462,643.98	67.03

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

				金额单位:人民币
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值 公允价值/净资产比例(%)
1	600724	宁波富达	11,600,000	82,824,000.00 4.41
2	600594	益盛药业	4,931,651	82,703,787.27 4.41
3	600763	东方	11,396,366	78,092,400.00 4.25
4	002445	中南重工	5,499,447	78,092,147.40 4.16
5	002283	天津油油	7,600,000	69,236,000.00 3.69
6	600582	康缘药业	5,499,942	64,349,321.40 3.43
7	002345	博彦科技	2,199,361	63,632,611.18 3.40
8	600298	安康药业	2,000,000	53,280,000.00 2.84

9	600754	锦江股份	2,723,509	45,074,073.95	2.40
10	600016	民生银行	7,000,000	43,890,000.00	2.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币

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	70,371,000.00	3.75
4	其中:政策性金融债	70,371,000.00	3.75
4	企业债券	25,000,500.00	1.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	95,371,500.00	5.08

5. 报告期末按公允价值计量的金融资产净值列前五名的前五名债券投资明细

3	126018	08江川铜债	50,000	4,220,500.00	0.22
5.6	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名支持证券投资明细				
5.6.1	报告期末未持有支持证券投资				
5.7	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股权投资明细				
5.8	报告期末未持有股权投资				
5.9	报告期内被前十名支持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				
5.9.1	个月内未受到公开谴责、处罚				
5.8.2	基金投资的前十名股票均属属于基金合同规定各选股票种之内股票。				
5.8.3	期末其他各项资产构成				
单位:人民币					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	2,305,430.18			

6	其他应收款	-
7	预付账款	-
8	其他	-
9	合计	5,531,056.87

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.8.5 本报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明

5.8.6 投资前五名股票中不存在流通受限情况

5.8.6 投资前五名股票中的其他主要说明

5.8.6 本报告期末投资托管行报告：本项投资经控股股东承派的证券，未从二级市场主动投资分交易

5.8.6 本报告期末，投资流通受限证券未违反相关法律法规或基金托管公司的规定。

**§ 7 影响投资者决策的其他重要信息**

报告期内本基金无其他重大事项。

**§ 8 备查文件目录**

8.1 备查文件目录

关于核准鑫证证券投资资金基金业协会无异议的批复《证监基金字〔2007〕344号》  
国统投股票型证券投资基金基金合同  
国统投股票型证券投资基金托管协议  
中国证券监督管理委员会公告  
国统投股票型证券投资基金招募说明书  
国统投股票型证券投资基金信息披露公告全文  
国统投股票型证券投资基金2012年第一季度报告原文

8.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

8.3 查阅方式

http://www.alhsdc.com

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件  
咨询电话:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

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	600125	铁龙物流	33,138,543	304,211,824.74	10.44

2	601933	永辉超市	6,364,308	190,229,166.12	6.53
3	600111	招商证券	2,607,328	174,005,217.28	5.97
4	600887	伊利股份	6,694,497	147,555,529.88	5.06
5	000799	西飞股份	4,599,338	129,031,417.66	4.43
6	600199	金种子酒	5,458,385	109,495,162.58	3.76
7	601089	中信银行	6,109,109	108,871,040.52	3.74
8	600837	海康威视	9,988,953	101,549,225.95	3.74
9	600016	民生银行	15,212,975	95,385,353.25	3.27
10	600436	青岛啤酒	1,322,639	91,354,675.72	3.14

- 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券资产。
- 5.5 报告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
- 5.6 报告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  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
- 5.7 报告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  
本基金本报告期末未持有权证资产。
- 5.8 投资组合报告附注  
5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查的，在报告编制日前一  
个月内未受到公开谴责、处罚。
- 5.8.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库中的股票。
- 5.8.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,250,000.00
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	99,865.15
5	应收申购款	254,895.54
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,544,760.69

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有债券资产。

5.8.5 报告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不存在流通受限的情况。

5.8.6 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。

八、开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额	4,604,430,055.17
本报告期基金总申购份额	330,053,690.07
减:本报告期基金总赎回份额	287,047,480.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,647,436,264.97

报告期内本基金管理人对本基金进行收益分配,每10份基金份额派发红利0.32元。指定媒体公告时间为2012年11月1日。

**§ 8 备查文件目录**

**8.1 备查文件目录**

关于同意国投瑞银创新动力股票型证券投资基金募集的批复(证监基金字〔2006〕189号)

关于国投瑞银创新动力股票型证券投资基金备案确认的《基金部》(基金部函〔2006〕283号)

国投瑞银创新动力股票型证券投资基金基金合同

国投瑞银创新动力股票型证券投资基金托管协议

8.2 存放地点  
中国广东省深圳市福田区金田路4028号来超经贸中心46层  
存放网址: <http://www.ubssdc.com>  
8.3 查阅方式  
投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件

咨询电话:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司  
二〇一二年四月二十一

---