

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  
送出日期:2013年3月27日

## § 1 重要提示及目录

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。基金年度报告经全体独立董事签字确认，并由董事长签字、盖章。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定，于2013年3月22日复核了本报告中的财务数据、净值表现、资产配置情况、财务数据报告、投资组合报告等內容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称 国投瑞银稳健增长混合  
基金代码 121006  
基金主代码 121006  
交易代码 121006 / 后端:128006  
运作方式 约定契约型  
基金合同生效日 2008年10月11日  
基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司  
基金托管人 中国工商银行股份有限公司  
报告期基金份额总额 3,315,468,428.86  
基金合同存续期 不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标 本基金通过配置债券类资产的合理配比,追求收益与风险的平衡,力求实现基金资产的长期增值。

本基金将追求主动的类货币资产配置策略,注重风险与收益的平衡。本基金将根据宏观经济和市场情况,选择具有资源优势的优质资产进行配置,追求基金资产的长期增值。

## 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 中国工商银行股份有限公司

## 2.4 信息披露

姓名 赵会军  
姓名 陈立  
联系电话 400-880-6868  
电子邮件 custody@icbc.com.cn  
客户服务电话 400-880-6868  
传真 0755-82904048  
010-66105798  
地址 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

2012年3月21日赵会军先生因公事,自2013年2月21日起由包丽华女士转任公司副总经理,不再担任基金经理,由刘先生担任公司督察长。

## 2.5 信息显示

网站 http://www.ubssdc.com  
管理人互联网网址

管理人年度报告备置地点 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、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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 -162,468,376.31 -229,257,445.02 18,403,160.63

本期利润 399,837,678.81 -592,247,276.69 5,269,465.41

加权平均基金份额本期利润 0.1216 -0.1971 0.0240

本期基金份额净值增长率 14.25% -12.73% 14.39%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供分配基金份额利润 -0.0529 -0.1086 0.0213

期末基金资产净值 3,376,055,180.63 3,510,402,662.57 2,470,666,462.23

期末基金份额净值 1.018 0.891 1.021

注:1.本期末实现收益按基金本期已实现收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,即为本期可供分配利润,扣除非经常性损益后的期末可供分配利润为负数时,扣除非经常性损益后的期末可供分配利润为零。2.对期末可供分配利润,采用期末可供分配利润与期末利润之和扣除本期利润后,即为实现的孰低的孰低金额。3.以上所述基金财务指标不包括持有人认购或交易本基金的费用,例如基金申购赎回费、基金转换费等,计算费用后实际可供分配金额将低于上述数字。

## 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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

注:1.本基金属于混合型基金。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基金股票配置比例范围40%-80%的中间值,即约60%为基础,债券等类别的股票的预期风险与收益将根据基金资产的配置比例和收益性等因素,本基金的投资业绩评价基准,具体为中行货币基金配置比例40%+信用债基金配置比例40%。

2.本基金的股票投资比例将根据基金资产的配置比例和收益性等因素,本基金的股票投资在基金资产中的占比将根据基金股票配置比例范围40%-80%的中间值,即约60%为基础,债券等类别的股票的预期风险与收益将根据基金资产的配置比例和收益性等因素,本基金的投资业绩评价基准,具体为中行货币基金配置比例40%+信用债基金配置比例40%。

3.以上所述基金财务指标不包括持有人认购或交易本基金的费用,例如基金申购赎回费、基金转换费等,计算费用后实际可供分配金额将低于上述数字。

## 3.2.2 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.3 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.4 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.5 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.6 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.7 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.8 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.98% 0.44%

过去六个月 8.88% 2.10% 6.73% 0.73% 4.07%

过去一年 14.25% 1.19% 6.44% 0.75% 7.81% 0.44%

过去三年 14.06% 1.06% -14.00% 0.83% 28.06% 0.23%

自基金合同生效日至至今 66.20% 1.06% -1.95% 1.09% 68.15% -0.03%

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71.34%,权证投资占基金净值比例0.05%,债券投资占基金净值比例13.95%,现金和到期后不超过一年的政府债券占基金净值比例14.47%,其中基金合同的相关规定。

## 3.2.9 基金合同生效以来基金每年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(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.28% 1.19% 6.30% 0.75% 10.9