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:2014年3月31日

国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金

2013 年度报告摘要

§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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月25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代表其未来表现。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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31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)
基金主代码	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
基金合同生效日	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
报告期末基金份额总额	77,709,711.31份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年1月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	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相关行业中的优质企业进行投资,分享新兴产业发展所带来的投资机会,在有效控制风险的前提下,力争为投资人带来长期的超额收益。
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略,注重风险与收益的平衡。本基金借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验,精选战略新兴产业及其相关行业中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。 本基金类别资产配置比例遵循以下原则: (1)股票投资占基金资产的30-80%; (2)权证投资占基金资产的比例不高于3%; (3)现金或到期日在一年以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,其预期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

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	田青
	联系电话	400-880-6868	010-67595096
	电子邮箱	service@ubssdic.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-880-6868	010-67595096
传真		0755-82904048	010-66275865

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	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	2013年	2012年	2011年12月13日-2011年12月31日
本期已实现收益	11,466,232.24	14,766,763.63	314,684.02
本期利润	12,562,628.80	17,886,403.81	314,684.02
加权平均基金份额本期利润	0.1502	0.1330	0.0005
本期基金份额净值增长率	23.19%	12.30%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.1433	0.1232	0.0005
期末基金资产净值	90,507,229.92	46,565,245.37	650,352,990.39
期末基金份额净值	1.165	1.123	1.000

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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,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,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

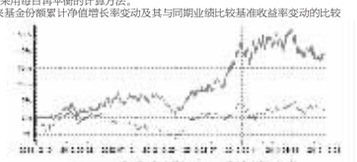
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.91%	1.18%	-1.82%	0.84%	-7.09%	0.34%
过去六个月	0.26%	1.37%	6.57%	0.84%	-6.31%	0.53%
过去一年	23.19%	1.41%	10.65%	0.86%	12.54%	0.55%
自基金合同生效日起至今	38.34%	1.16%	5.23%	0.84%	33.11%	0.32%

注:1.本基金属于灵活配置混合型基金。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以基金股票配置比例范围30-80%的中间值,即55%为基准,根据股市、债市等类别资产的预期风险与预期收益的综合比较与判断进行调整。为此,综合基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金选用中证新兴产业指数和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。

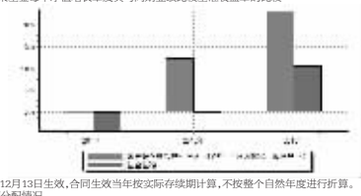
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自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



注:本基金合同于2011年12月13日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	1.860	285,537,771.10	3,754,030.07	289,291,801.17	
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
合计	1.860	285,537,771.10	3,754,030.07	289,291,801.17	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司(简称"公司"),原中融基金管理有限公司,经中国证券监督管理委员会批准,于2002年6月13日正式成立,注册资本1亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司,公司股东为国投信托有限公司(国家开发投资公司的全资子公司)及瑞士银行股份有限公司(UBS AG)。公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效的风险管理及控制策略,以"诚信、客户关注、包容性、社会责任"作为公司的企业文化。截止2013年12月底,公司有员工146人,其中88人具有硕士或博士学位;公司管理23只基金,其中包括2只创新型分级基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐炜哲	本基金基金经理、基金投资部副总监	2011年12月13日	2013年6月15日	13	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任美国纽约Davis Polk & Wardwell资本市场部分析员,国信证券研究部高级分析师,中信基金研究部高级经理,CLSA Limited(里昂证券)中国研究部分析师。2006年8月加入国投瑞银,曾任国投瑞银融华债券基金基金经理,现兼任国投瑞银创新动力基金基金经理。
马少章	本基金基金经理	2011年12月13日	2013年10月26日	16	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任职于金信证券、东吴基金及红塔证券。2008年4月加入国投瑞银。曾任国投瑞银沪深300金融地产指数基金(LOF)基金经理。现兼任国投瑞银景气行业基金和国投瑞银稳健增长基金基金经理。
孟亮	本基金基金经理	2012年3月10日	-	9	中国籍,博士,具有基金从业资格。曾任职于上投摩根基金管理有限公司。2010年4月加入国投瑞银,曾任国投瑞银消费服务指数基金(LOF)和国投瑞银沪深300金融地产指数基金(LOF)基金经理。现兼任国投瑞银融华债券基金和国投瑞银创新动力基金基金经理。
桑俊	本基金基金经理助理、高级研究员。	2013年8月5日	-	6	中国籍,博士,具有基金从业资格。曾任国海证券研究所分析师。2012年5月加入国投瑞银基金管理有限公司研究部。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内,基金的投资决策规范,基金运作合法合规,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度,并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则:

1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时,坚持基金持有人利益优先;

2、当不同产品/客户/组合之间存在利益发生冲突时,应公平的对待不同的产品/客户/组合;

3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合;

4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下:

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程,提高投资管理的科学性和客观性,确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动,同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系,加强交易分配的内控控制,通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现,同时通过监察稽核,事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下:

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统,充分发挥系统的自动控制功能,根据公平交易管理的要求,在系统中设置相应业务流转顺序、控制阀值或者触发机制,对触及阀值的行为视情况分别采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务日动执行必要的后续流程。如:符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易,内部研究员信在研究系统中一经发布会日动推送到所有基金经理、投资经理,控制阀值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动,通过建立明确的业务规则和流程,在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制,通过分阶对控制环节签署意见并顺序流转的要求,实现对关键业务风险的管理。如:以公司名义进行的一级市场申购结果分配,需要经过严格的公平性审核,由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后方有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位,分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控,并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况,监督督促公平交易制度的执行。如:交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督,监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核,监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析,发现控制薄弱环节或交易价差异常,将重新修查公司投资决策和交易执行环节的内控控制,针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中,披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明,接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查,公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时,将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况,并对其内部控制的有效性、公平交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题,也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式,也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析,并会问证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为,将依法采取相关监管措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现,确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效地公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

报告期内,管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下:

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析,对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行T检验,检验在95%的可信水平下,价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较,区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况。

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算,检查在过去四个季度内,是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示,公司管理的所有投资组合,在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年,新一届政府加快国内产业结构的调整,产业技术能力和经济发展效益的发展模式,正在加速取代以往推动国内经济增长的主流模式——大量货币发行和大量以基建为主的固定资产投资,管理层开始加快采取措施,刺破当前经济发展中的投机泡沫,中国经济的中长期发展前景及各相关行业的中长期估值正发生全局性的变更;传统的周期性行业比如钢铁、水泥、大宗商品面临需求减弱而出现的一定的产能过剩等问题,受中国宏观经济总体处于转型调整态势制约。另一方面,从国经济的发展韧性不容忽视,部分行业和公司在宏观经济低迷的大背景下依然表现出蓬勃的发展势头,结构性行情在2012年的基础上进一步演绎。

在这样的背景下,A股市场总体表现低迷,上证指数跌-6.75%,深证成指跌-10.91%,在结构转型的同时,中小板和创业板表现非常强势;其中传媒、通信、计算机、电子以及环保为代表的新兴产业涨幅明显居前,估值水平不断提升,部分甚至超过了历史高点;同时以煤炭、有色、银行、钢铁为代表的大盘蓝筹股跌幅居前。

我们同时看到安防、电子、通信、医药、传媒、游戏、环保、家电、汽车等行业或公司在不同阶段均获得了各自的表现机会,市场的操作难度进一步增大。首先,流动性冲击的突然和深度都较往年增大,政策预期波动也明显增加;其次,受转型预期影响,行业间的表现差异巨大,投资者稍微判断失误就有可能受损失;最后,有机会的行业也只是在某一时段表现较好,贯穿全年的投资机会少之又少。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2013年主要使用自下而上的投资方法,重点配置了安防、电子、医药、油气设备等行业或个股。截止报告期末,本基金份额净值为1.165元,本报告期份额净值增长率为23.19%,同期业绩比较基准收益率为10.65%。基金净值增长率高于比较基准是因为本基金在2013年坚持以成长股为核心的投资逻辑,适度减持了周期股,增加了TMT、传媒等新兴产业行业的配置权重,并且在那沙周期股上进行了波段性操作。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,我们认为经济处于转型期的大格局不变,有价值的行业或公司也将继续涌现,价值投资者还有机会可以挖掘。从管理层的一系列政策措施来看,未来财政、金融、投资、价格等领域改革会逐步推广开来,未来民生保障、城镇化、农业现代化等相关政策也会陆续出台,尤其是近期包括中国(上海)自由贸易区的批准,上地流转制度推进和计划生育政策调整等改革预期亟燃;制度改革带来的制度红利释放、金融体系改革提升、生产效率提高都将为未来经济增长提供新的驱动力。尤其是管理层近期明确表示大量推动产业升级,扶持新兴产业政策将加快中国经济迈向以高新技术为核心产业链的全新时代。需要重点关注的是流动性冲击对市场的影响可能进一步加大,同时随着IPO巨量发行,以及审核制逐步向注册制过度,市场的估值体系可能面临重构,这对未来一年的投资提出了较大的挑战。

本基金将继续坚持价值挖掘的思路,积极投资符合我们投资逻辑的优质公司,同时加强波段交易,尽量缩减基金的净值回落幅度,为持有人创造彰极回报。在投资标的选择方面,我们依然倾向于选择以TMT为主的新兴产业的投资机会。虽然周期股在某个阶段也会有交易性机会,但我们认为,站在全年的角度看,成长股的回报一定会好于周期股。我们将致力于挖掘成长股中的优质企业重点投入,坚定并长期持有。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估,并对基金估值程序进行监督;估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等事项,估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以及监察稽核部指定人员;运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,设立基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关成员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。

本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行,运营部内部复核估值结果,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的勤业敏感,向估值小组提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管行沟通,在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为11,466,232.24元,期末可供分配利润为11,134,321.95元。

本基金与2013年1月18日以2013年1月8日基金已实现的可分配收益为基准,实施收益分配579,326.90元,每10份基金份额分红0.16元。

本基金于2013年4月10日以2013年3月31日基金已实现的可分配收益为基准,实施收益分配288,712,474.27元,每10份基金份额分红1.70元。

本基金本期未无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600485	中创信测	2013-12-17	重大资产重组	20.51	2014-01-13	21.50	70,400	1,630,100.94	1,443,904.00
002266	浙富控股	2013-12-06	重大资产重组	9.25	2014-01-16	10.18	97,053	562,711.76	897,740.25
300047	天源迪科	2013-12-26	重大资产重组	10.11	2014-03-20	11.12	81,400	928,512.00	822,954.00
601012	隆基股份	2013-12-17	重大资产重组	15.41	2014-01-13	14.78	27,400	441,894.00	422,234.00
300071	华谊嘉信	2013-11-25	重大资产重组	29.00	N/A	N/A	8,400	236,851.00	243,600.00
000625	长安汽车	2013-12-31	公告重大事项	11.45	2014-01-03	11.72	20,084	181,561.46	229,961.80

注:本基金截至2013年12月31日上持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的,除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为67,806,243.77元,第二层级4,060,394.05元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级35,699,193.24元,无属于第二、三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于交易不活跃期间将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012年12月31日:同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为0.00元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为0.00元(2012年度:净转入/(转出)第三层级的金额为0.00元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为0.00元,涉及酒鬼酒股份有限公司("酒鬼酒")发行的股票)。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,132,146.32	75.00
	其中:股票	69,132,146.32	75.00
2	固定收益投资	2,734,491.50	2.97
	其中:债券	2,734,491.50	2.97
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	20,240,991.53	21.96
6	其他各项资产	72,319.36	0.08
7	合计	92,179,948.71	100.00

8.2 期末按行业类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	采矿业	-	-
C	制造业	54,661,388.92	60.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,050.00	0.15
E	建筑业	1,677,430.50	1.85
F	批发和零售业	618,448.00	0.68
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	6,233,247.17	6.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,257,635.80	2.49
M	科学研究和技术服务业	1,069,226.40	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	2,219,074.25	2.45
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	256,645.28	0.28
S	综合	-	-
	合计	69,132,146.32	76.38

8.3 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:人民币元

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	002241	歌尔声学	147,321	5,168,020.68	5.71
2	002353	杰瑞股份	58,060	4,608,222.20	5.09
3	002236	大华股份	95,712	3,912,706.56	4.32
4	002415	海康威视	148,130	3,404,027.40	3.76
5	300228	富瑞特装	33,332	2,633,228.00	2.91
6	000977	浪潮信息	53,598	2,424,237.54	2.68
7	002038	双鹭药业	45,914	2,320,952.70	2.56
8	002653	海思科	107,892	2,133,024.84	2.36
9	600566	洪城股份	106,800	2,129,592.00	2.35
10	300058	蓝色光标	38,881	2,014,035.80	2.23

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	8,614,376.96	18.50
2	002236	大华股份	5,011,529.82	10.76
3	600332	白云山	4,624,305.75	9.93
4	002353	杰瑞股份	4,472,056.08	9.60
5	002450	康得新	4,293,977.60	9.22
6	002573	国电清新	3,764,484.06	8.08
7	600867	通化东宝	3,558,121.79	7.64
8	002038	双鹭药业	3,321,349.98	7.13
9	600837	海通证券	3,178,581.80	6.83
10	600315	上海家化	3,163,658.00	6.79
11	000800	一汽轿车	3,126,792.00	6.71
12	002415	海康威视	3,093,023.74	6.64
13	300074	华平股份	3,070,642.35	6.59
14	600340	华夏幸福	2,987,066.40	6.41
15	002550	千红制药	2,958,104.47	6.35
16	000002	万 科A	2,859,845.00	6.14
17	600352	浙江龙盛	2,755,196.10	5.92
18	002653	海思科	2,711,817.94	5.82
19	300228	富瑞特装	2,631,799.60	5.65
20	300014	亿纬锂能	2,490,262.29	5.35
21	002635	安洁科技	2,412,469.70	5.18
22	300115	长盈精密	2,399,508.70	5.15
23	601633	长城汽车	2,396,193.52	5.15
24	000977	浪潮信息	2,321,697.20	4.99
25	600157	永泰能源	2,263,484.00	4.86
26	600406	国电南瑞	2,260,160.44	4.85
27	600383	金地集团	2,246,820.00	4.83
28	600048	保利地产	2,220,305.00	4.77
29	000538	云南白药	2,193,126.37	4.71
30	601231	环旭电子	2,188,209.91	4.70
31	300339	润和软件	2,130,145.50	4.57
32	000049	德赛电池	2,082,796.61	4.47
33	002309	中利科技	2,070,998.30	4.45
34	600518	康美药业	2,002,338.80	4.30
35	300133	华策影视	1,908,570.00	4.10
36	600566	洪城股份	1,900,641.53	4.08
37	300058	蓝色光标	1,865,386.92	4.01
38	600827	友谊股份	1,831,471.50	3.93
39	002456	欧菲光	1,827,576.87	3.92
40	300168	万达信息	1,823,501.60	3.92
41	002475	立讯精密	1,803,825.81	3.87
42	300055	万邦达	1,789,732.57	3.84
43	002024	苏宁云商	1,789,420.00	3.84
44	000157	中联重科	1,777,787.00	3.82
45	600252	中恒集团	1,751,417.00	3.76
46	000661	长春高新	1,749,896.02	3.76
47	601166	兴业银行	1,723,963.00	3.70
48	000562	宏源证券	1,634,965.00	3.51
49	600485	中创信测	1,630,100.94	3.50
50	600079	人福医药	1,566,543.00	3.36
51	000625	长安汽车	1,560,880.85	3.35
52	300105	龙源技术	1,540,858.63	3.31
53	300070	碧水源	1,522,288.92	3.27
54	600880	博瑞传播	1,507,836.00	3.24
55	600517	置信电气	1,491,695.99	3.20
56	300207	欣旺达	1,487,844.00	3.19
57	600403	大有能源	1,443,696.43	3.10
58	000651	格力电器	1,433,101.00	3.08
59	600597	光明乳业	1,393,895.33	2.99
60	300215	电科院	1,393,665.50	2.99
61	000400	许继电气	1,392,036.10	2.99
62	002376	新北洋	1,356,597.00	2.91
63	600388	龙净环保	1,346,362.70	2.89
64	601222	林洋电子	1,335,403.00	2.87
65	000625	长安汽车	1,299,967.03	2.79
66	300088	长信科技	1,290,694.38	2.77
67	002146	荣盛发展	1,276,332.90	2.74
68	002244	滨江集团	1,272,208.00	2.73
69	002106	莱宝高科	1,268,510.25	2.72
70	300118	东方日升	1,256,410.29	2.70
71	002325	洪涛股份	1,188,687.35	2.55
72	002055	得润电子	1,178,317.67	2.53
73	600325	华发股份	1,164,045.60	2.50
74	600581	八一钢铁	1,163,374.87	2.50
75	002008	大族激光	1,159,796.90	2.49
76	300057	万顺股份	1,158,166.00	2.49
77	600481	双良节能	1,149,422.52	2.47
78	601117	中国化学	1,136,862.00	2.44
79	600546	山煤国际	1,117,507.11	2.40
80	600256	广汇能源	1,055,863.00	2.27
81	600104	上汽集团	1,044,283.00	2.24
82	600563	法拉电子	1,037,896.10	2.23
83	600329	中新药业	1,029,709.00	2.21
84	601886	江河创建	1,012,051.68	2.17
85	600030	中信证券	1,000,346.61	2.15
86	000731	四川美丰	988,054.30	2.12
87	600703	三安光电	967,509.50	2.08
88	601318	中国平安	962,442.00	2.07
89	000522	白云山A	958,366.00	2.06