

**国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金2011年年度报告摘要**

**2011年12月31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**

**送出日期：2012年03月29日**

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年3月26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2011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	国投瑞银沪深300指数分级		
基金主代码	161207		
基金运作方式	<p>契约型开放式。</p> <p>本基金的基金份额包括本基金之基础份额（简称“瑞和300 份额”）、本基金之小康份额（简称“瑞和小康份额”）与本基金之远见份额（简称“瑞和远见份额”）。其中，瑞和小康份额、瑞和远见份额的基金份额配比始终保持1：1 的比率不变。瑞和300份额开通场外与场内两种方式的申购与赎回，瑞和小康份额与瑞和远见份额在深圳证券交易所上市交易。</p>		
基金合同生效日	2009年10月14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		
报告期末基金份额总额	1,407,029,171.94		
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	2009年11月19日		
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞和沪深300指数（场内简称“瑞和300”）	国投瑞银瑞和小康沪深300指数（场内简称“瑞和小康”）	国投瑞银瑞和远见沪深300指数（场内简称“瑞和远见”）
下属分级基金的交易代码	161207	150008	150009
报告期末下属分级基金的份额总额	868,314,171.94	269,357,500.00	269,357,500.00

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金通过被动的指数化投资管理，实现对沪深300指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。</p>
------	--

投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪基准指数。</p> <p>当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况（如股权分置改革等）导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。</p>
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	包爱丽	赵会军
	联系电话	400-880-6868	010-66105799
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105798

### 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	<a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a>
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	2011年	2010年	2009年10月14日-2009年12月31日
本期已实现收益	-162,248,991.76	-222,138,798.71	4,051,950.89
本期利润	-439,234,236.03	-546,821,044.87	193,132,231.87
加权平均基金份额本期利润	-0.2226	-0.2053	0.0605
本期基金份额净值增长率	-24.11%	-12.14%	6.00%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3693	-0.0894	0.0013
期末基金资产净值	1,254,192,823.36	2,309,665,815.81	3,327,256,173.46
期末基金份额净值	0.891	0.973	1.060

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（例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等），计入费用后实际收益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

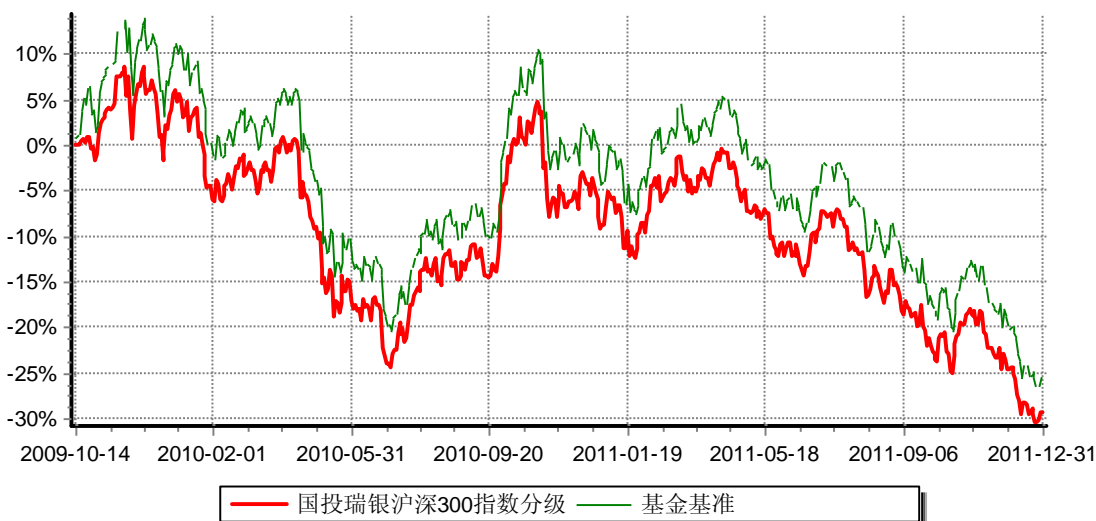
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.39%	1.32%	-8.66%	1.34%	0.27%	-0.02%
过去六个月	-22.03%	1.28%	-21.87%	1.29%	-0.16%	-0.01%
过去一年	-24.11%	1.23%	-23.82%	1.23%	-0.29%	-0.00%
自基金合同生效日起至今	-29.32%	1.38%	-25.24%	1.40%	-4.08%	-0.02%

注：1、本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。本基金是以沪深300指数为标的指数的被动式、指数型基金，对沪深300指数成份股的配置基准为95%，故以此

为业绩比较基准，能够准确地反映本基金的投资绩效。

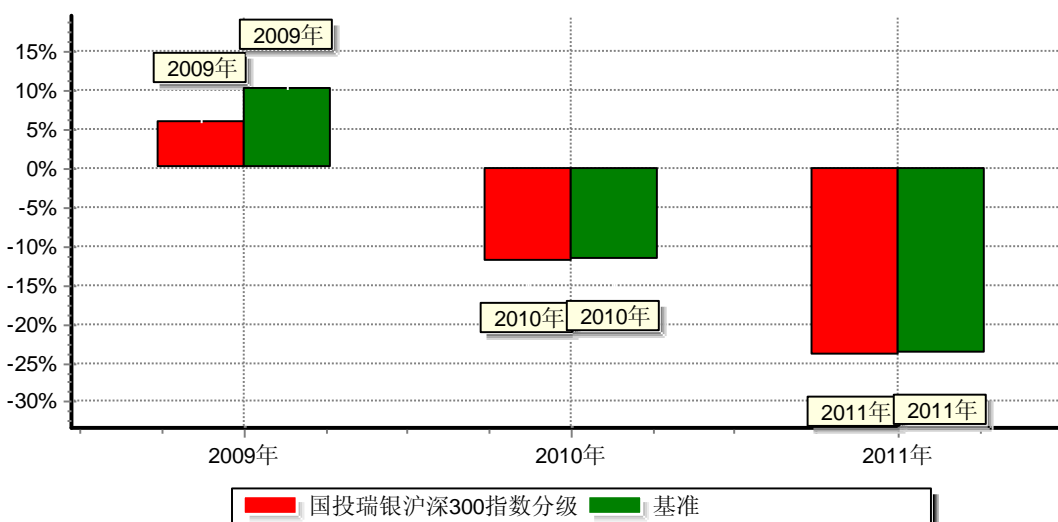
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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：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94.72%，权证投资占基金净值比例0%，债券投资占基金净值比例3.92%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例5.07%，符合基金合同的相关规定。

### 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2009年10月14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

根据本基金合同的约定，在瑞和小康份额、瑞和远见份额的存续期内，本基金（包括瑞和300 份额、瑞和小康份额、瑞和远见份额）不进行收益分配。

## § 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，注册地深圳。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架构，以“诚信、客户关注、包容性、社会责任”作为公司的企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截止2011年12月底，公司管理18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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
LU RONG QIANG	本基金基金经理、国际业务部副总监	2009年10月14日	—	12	澳大利亚籍，澳大利亚新南威尔士大学基金管理专业硕士，具有基金从业资格。曾任康联首域投资基金公司投资经理、投资分析师；联邦基金公司数量分析师、投资绩效分析员；美世投资管理顾问公司投资分析师。2008年2月加入国投瑞银。
熊志勇	本基金基金经理	2010年11月27日	2011年08月17日	6	中国籍，英国考文垂大学博士研究生，具有基金从业资格。曾任职于天狮投资中心、华安基金管理有

					限公司，从事量化分析和证券研究工作。2009年12月加入国投瑞银。
--	--	--	--	--	-----------------------------------

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。证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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合规守信情况的说明

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《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本资产管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立完善了公平交易相关的系列制度，通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，以确保本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。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本公司未管理其他投资风格与本基金相似的投资组合，不存在投资风格相似的不同投资组合之间的业绩表现差异超过5%之情形。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现可能的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年，通胀是影响中国宏观经济的最主要因素。在2011年上半年，通胀压力居高不下，央行货币政策持续紧缩，每月上调1次上调存款准备金率合计3个百分点，并加息3次合计0.75个百分点。受紧缩政策的影响，货币信贷增速大幅回落，中国经济明显放缓。进入3季度以后，随着通胀见顶回落、海外经济形势急速恶化，政策开始微调、预调，央行于11月30日宣布下调商业银行存款准备金率0.5个百分点，标志着中国宏观经济政策开始转向。

基金投资操作上，作为指数基金，投资操作以严格控制跟踪误差为主，积极应对成分股调整、成分股替代停牌机会成本、同时也密切关注基金申购赎回及市场出现结构性机会。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现



截止报告期末，本基金份额净值为0.891元，本报告期份额净值增长率为-24.11%，同期沪深300指数增长率为-25.0%，业绩基准增长率为-23.82%，基金净值增长率落后于业绩基准收益率0.29%，落后基准主要源于报告期内指数成分股调整和申购赎回影响。报告期内，日均跟踪误差为0.05%，年化跟踪误差为0.79%，符合基金合同分别约定的跟踪误差不超过0.35%以及4.0%的限制。

#### 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2012年，在全球经济放缓、人民币累计升值效应进一步显现的情况下，明年中国出口增速将进一步下滑，而投资增速也由于房地产开发投资增速的大幅放缓而面临下滑压力，中国政府将通过积极财政政策来稳增长。我们预计1季度中国经济增长的压力最大，此轮经济增长环比增速低点有较大可能出现在2012年1季度，而同比增速则有望在2季度见底，中国经济将呈现前低后高的走势，全年经济同比增速将回落到8%-8.5%的区间。就物价而言，由于经济放缓，通胀压力将继续缓解，由于基数效应的影响，2012年CPI将呈现U型走势，全年通胀低点预计出现在3季度。

作为国内首只创新型分级指数基金，本基金将恪守基金合同，继续系统化、科学化地采取指数化投资策略，做好跟踪误差管理。积极应对成份股调整、基金申购赎回、自身费用计提等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差，力争为市场提供一个清晰透明、可靠可信的资产配置型的创新型指数投资工具。

#### 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职业敏感，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，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定，在瑞和小康份额、瑞和远见份额的存续期内，本基金（包括瑞和300份额、瑞和小康份额、瑞和远见份额）不进行收益分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年，本基金托管人在对国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年，国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金2011年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

经普华永道中天会计师事务所审计，注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：		
银行存款	14,429,070.06	129,622,802.01

结算备付金		3,742,858.06
存出保证金	896,831.42	556,335.49
交易性金融资产	1,237,159,677.22	2,181,344,772.93
其中：股票投资	1,187,999,677.22	2,181,344,772.93
基金投资	—	—
债券投资	49,160,000.00	—
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	2,682,461.04	—
应收利息	772,181.24	28,623.04
应收股利	—	—
应收申购款	72,655.47	33,533.49
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,256,012,876.45	2,315,328,925.02
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2011年12月31日</b>	<b>2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	133,338.91	1,719,187.13
应付管理人报酬	1,100,870.24	2,021,572.93
应付托管费	242,191.44	444,746.06
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	243,161.20	1,371,140.81
应交税费	—	—
应付利息	—	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	100,491.30	106,462.28
负债合计	1,820,053.09	5,663,109.21
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,773,776,085.79	2,480,213,685.65
未分配利润	-519,583,262.43	-170,547,869.84
所有者权益合计	1,254,192,823.36	2,309,665,815.81
负债和所有者权益总计	1,256,012,876.45	2,315,328,925.02

注：报告截止日2011年12月31日，国投瑞银瑞和沪深300指数份额净值0.891元，国投瑞银瑞和小康沪深300指数份额净值0.891元，国投瑞银瑞和远见沪深300指数份额净值0.891元；基金份额总额1,407,029,171.94份，其中国投瑞银瑞和沪深300指数份额868,314,171.94份，国投瑞银瑞和小康沪深300指数份额269,357,500.00份，国投瑞银瑞和远见沪深300指数份额269,357,500.00份。

## 7.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

本报告期：2011年01月01日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年01月01日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年01月01日至 2010年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>-410,200,287.76</b>	<b>-509,450,411.28</b>
1.利息收入	1,254,393.71	1,116,172.33
其中：存款利息收入	712,723.22	1,115,481.64
债券利息收入	541,670.49	690.69
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-135,232,695.86	-188,023,642.45
其中：股票投资收益	-156,891,738.64	-211,500,308.76

基金投资收益	—	—
债券投资收益	428,506.77	398,280.73
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	21,230,536.01	23,078,385.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-276,985,244.27	-324,682,246.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	763,258.66	2,139,305.00
<b>减：二、费用</b>	<b>29,033,948.27</b>	<b>37,370,633.59</b>
1. 管理人报酬	18,829,140.28	24,772,612.88
2. 托管费	4,142,410.90	5,449,974.88
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	5,582,473.44	6,733,023.40
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	479,923.65	415,022.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-439,234,236.03</b>	<b>-546,821,044.87</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-439,234,236.03</b>	<b>-546,821,044.87</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

本报告期：2011年01月01日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年01月01日至2011年12月31日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,480,213,685.65	-170,547,869.84	2,309,665,815.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-439,234,236.03	-439,234,236.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-706,437,599.86	90,198,843.44	-616,238,756.42
其中：1.基金申购款	1,132,173,762.36	-10,729,397.77	1,121,444,364.59
2.基金赎回款	-1,838,611,362.22	100,928,241.21	-1,737,683,121.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,773,776,085.79	-519,583,262.43	1,254,192,823.36
项 目	上年度可比期间2010年01月01日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,138,781,189.76	188,474,983.70	3,327,256,173.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-546,821,044.87	-546,821,044.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-658,567,504.11	187,798,191.33	-470,769,312.78
其中：1.基金申购款	3,314,807,767.17	-8,745,259.18	3,306,062,507.99
2.基金赎回款	-3,973,375,271.28	196,543,450.51	-3,776,831,820.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	2,480,213,685.65	-170,547,869.84	2,309,665,815.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

尚健

刘纯亮

冯伟

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]865号《关于核准国投瑞银瑞和沪深

300指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,215,075,553.30元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第204号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》于2009年10月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,215,923,206.99份基金份额，其中认购资金利息折合847,653.69份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括国投瑞银瑞和沪深300指数证券投资基金之基础份额(以下简称"瑞和沪深300指数份额")、国投瑞银瑞和沪深300指数证券投资基金之小康份额(以下简称"瑞和小康份额")及国投瑞银瑞和沪深300指数证券投资基金之远见份额(以下简称"瑞和远见份额")。本基金一份瑞和小康份额与一份瑞和远见份额构成一对份额组合，一对瑞和小康份额与瑞和远见份额的份额组合的净值之和将等于两份瑞和沪深300指数份额的净值。在任一运作周年内，如果瑞和沪深300指数份额的基金份额净值大于1.000元，则在每份瑞和小康份额与每份瑞和远见份额各自获得1.000元净值的基础上，本基金将以年阀值(10%)为基准，将瑞和沪深300指数份额的基金份额净值超出1.000元的部分划分成年阀值以内和年阀值以外的两个部分，与此相对应，对于每一对瑞和小康沪深300指数份额与瑞和远见份额的份额组合所包含的年阀值以内的部分，由一份瑞和小康份额与一份瑞和远见份额按8：2的比例分成；对于每一对瑞和小康份额与瑞和远见份额的份额组合所包含的年阀值以外的部分，由一份瑞和小康份额与一份瑞和远见份额按2：8的比例分成。在任一运作周年内，如果瑞和沪深300指数份额的基金份额净值小于或等于1.000元，则瑞和小康份额、瑞和远见份额的基金份额净值相等，且等于瑞和沪深300指数份额的基金份额净值。

在瑞和小康份额、瑞和远见份额存续期内的每一个运作周年的最后一个工作日，本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对本基金所有份额进行基金份额折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为1.000元。其中，如果瑞和沪深300指数份额折算前的基金份额净值大于1.000元，基金份额折算后，基金份额持有人持有的瑞和沪深300指数份额的份额数按照折算比例相应增加，瑞和小康份额、瑞和远见份额各自的新增份额将全部折算成基金份额持有人持有的瑞和沪深300指数份额；如果瑞和沪深300指数份额折算前的基金份额净值小于或等于1.000元，基金份额折算后，基金份额持有人持有的瑞和沪深300指数份额、瑞和小康份额、瑞和远见份额各自的份额数按照折算比例相应缩减。

瑞和沪深300指数份额接受场外与场内申购和赎回，瑞和小康份额、瑞和远见份额只上市交易但不接受申购和赎回，并可与瑞和沪深300指数份额相互间进行配对转换。经深

圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2009]150号文核准,瑞和小康份额、瑞和远见份额于2009年11月19日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资的标的指数为沪深300指数,股票投资占基金资产的比例为85%-95%,原则上投资于沪深300指数成份股票、备选成份股票的资产占基金资产的比例不低于80%;除股票以外的其他资产投资占基金资产的比例为5%-15%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深300指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司于2012年3月23日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011年度 财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年12月31日 的财务状况以及2011年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本期采用的会计政策、会计估计与上年度可比期间相一致。

#### 7.4.5会计差错更正的说明

本基金本期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及



其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
国投信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年01月01日至2011 年12月31日	上年度可比期间 2010年01月01日至2010 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,829,140.28	24,772,612.88
其中：支付销售机构的客户维护费	658,029.22	598,027.33

注：支付基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年01月01日至2011 年12月31日	上年度可比期间 2010年01月01日至2010 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,142,410.90	5,449,974.88

注：支付基金托管人 中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 ×0.22% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011 年度	上年度可比期间 2010 年度
国投瑞银瑞和沪深 300 指数		
期初持有的基金份额	9,577,988.75	10,006,700.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因折算变动份额	-1,640,359.87	-428,711.25
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,937,628.88	9,577,988.75
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.91%	1.24%

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年01月01日至2011年12月31 日		上年度可比期间 2010年01月01日至2010年12月31 日	
	期末 存款余额	当期 存款利息收入	期末 存款余额	当期 存款利息收入
中国工商银行	14,429,070.06	684,517.56	129,622,802.01	1,071,235.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/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 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额
600132	重庆啤酒	2011-12-23	重要事项未公告	28.45	2011-01-10	25.61	88,156	5,863,685.60	2,508,038.2

注：本基金截至2011年12月31日止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) 各层次金融工具公允价值

于2011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1,185,491,639.02元，属于第二层级的余额为51,668,038.20元，无属于第三层级的余额（2010年12月31日：第一层级2,154,055,914.27元，第二层级27,288,858.66元，无第三层级）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间不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或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	1,187,999,677.22	94.58
	其中：股票	1,187,999,677.22	94.58
2	固定收益投资	49,160,000.00	3.91
	其中：债券	49,160,000.00	3.91
	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	14,429,070.06	1.15
6	其他各项资产	4,424,129.17	0.35
7	合计	1,256,012,876.45	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	—	—
C	制造业	2,992,500.00	0.24
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	2,992,500.00	0.24
C8	医药、生物制品	—	—
C99	其他制造业	—	—
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	—	—
G	信息技术业	—	—
H	批发和零售贸易	—	—
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	—	—
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	2,992,500.00	0.24

### 8.2.2 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	5,422,487.33	0.43
B	采掘业	136,073,326.12	10.85
C	制造业	395,394,661.77	31.53
C0	食品、饮料	89,270,953.06	7.12
C1	纺织、服装、皮毛	6,909,648.54	0.55
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	24,039,725.59	1.92
C5	电子	6,761,522.28	0.54
C6	金属、非金属	83,026,548.78	6.62
C7	机械、设备、仪表	131,122,159.14	10.45
C8	医药、生物制品	54,264,104.38	4.33
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,811,064.46	2.06
E	建筑业	35,197,036.58	2.81
F	交通运输、仓储业	40,937,850.24	3.26
G	信息技术业	47,125,391.85	3.76
H	批发和零售贸易	32,265,056.16	2.57
I	金融、保险业	374,206,631.72	29.84
J	房地产业	59,508,356.95	4.74
K	社会服务业	11,856,852.11	0.95
L	传播与文化产业	2,879,451.18	0.23
M	综合类	18,329,010.75	1.46
	合计	1,185,007,177.22	94.48

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	600036	招商银行	3,630,028	43,088,432.36	3.44

2	600016	民生银行	6,808,454	40,101,794.06	3.20
3	601318	中国平安	972,275	33,485,151.00	2.67
4	601166	兴业银行	2,249,184	28,159,783.68	2.25
5	600000	浦发银行	3,307,354	28,079,435.46	2.24
6	601328	交通银行	6,203,253	27,790,573.44	2.22
7	601088	中国神华	941,169	23,839,810.77	1.90
8	600519	贵州茅台	118,570	22,919,581.00	1.83
9	000002	万科A	3,008,953	22,476,878.91	1.79
10	000858	五粮液	592,872	19,446,201.60	1.55

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

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601633	长城汽车	250,000	2,992,500.00	0.24

### 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	002036	宜科科技	33,597,817.26	1.45
2	600893	航空动力	26,697,702.26	1.16
3	600585	海螺水泥	26,081,959.17	1.13
4	600016	民生银行	21,438,730.00	0.93
5	000858	五粮液	19,894,875.45	0.86
6	600010	包钢股份	18,009,686.60	0.78
7	000063	中兴通讯	17,948,017.61	0.78
8	600000	浦发银行	17,797,994.01	0.77
9	600395	盘江股份	17,720,596.78	0.77

10	000157	中联重科	17,210,357.14	0.75
11	600837	海通证券	16,354,523.15	0.71
12	600376	首开股份	16,147,926.96	0.70
13	000776	广发证券	16,139,429.33	0.70
14	600036	招商银行	15,841,724.03	0.69
15	600104	上汽集团	15,656,982.11	0.68
16	601166	兴业银行	15,310,858.03	0.66
17	000758	中色股份	14,935,666.04	0.65
18	600111	包钢稀土	14,763,629.18	0.64
19	601699	潞安环能	14,180,199.21	0.61
20	601939	建设银行	13,564,482.19	0.59

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	38,253,428.08	1.66
2	600016	民生银行	36,136,744.72	1.56
3	002036	宜科科技	32,971,433.09	1.43
4	601166	兴业银行	28,871,616.53	1.25
5	600585	海螺水泥	28,010,135.05	1.21
6	601318	中国平安	27,933,036.02	1.21
7	000858	五粮液	26,343,286.91	1.14
8	601328	交通银行	25,658,296.38	1.11
9	600000	浦发银行	24,559,533.74	1.06
10	600893	航空动力	23,710,330.15	1.03
11	000063	中兴通讯	20,055,934.63	0.87
12	600010	包钢股份	19,940,292.38	0.86
13	600111	包钢稀土	19,864,616.94	0.86
14	000895	双汇发展	19,651,805.22	0.85



15	601601	中国太保	19,650,213.40	0.85
16	601699	潞安环能	19,477,538.69	0.84
17	600104	上汽集团	19,220,149.35	0.83
18	600395	盘江股份	18,995,449.70	0.82
19	601088	中国神华	18,382,068.99	0.80
20	600030	中信证券	17,784,500.20	0.77

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,452,256,673.74
卖出股票收入（成交）总额	2,014,012,359.34

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	49,160,000.00	3.92
	其中：政策性金融债	49,160,000.00	3.92
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	49,160,000.00	3.92

### 8.6 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

金额单位：人民币元

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	110245	11国开45	500,000	49,160,000.00	3.92

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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

本基金本期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券中，包括“五粮液”592,872股，市值1,945万元，占基金资产净值1.55%。根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月28日公告，由于该公司存在信息披露不及时、不完整行为，中国证监会对该公司以及公司相关责任人员依法实施了警告和罚款的处罚（具体内容请参看该公司《关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告》）。基金管理人认为，该处罚有利于促进公司加强对信息披露工作的管理，进一步规范公司的治理结构，处罚对公司今年以来的经营活动没有产生实质性影响，未改变公司基本面，该处罚事件尚不足以影响该股票的投资价值，基金对该股票的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

除上述情况外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.9.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	896,831.42
2	应收证券清算款	2,682,461.04
3	应收股利	—
4	应收利息	772,181.24
5	应收申购款	72,655.47
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,424,129.17

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本期末未投资托管行股票、未投资控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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有 的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份额 比例	持有 份额	占总份额 比例
国投瑞银瑞和沪 深300指数	8188	106,047.16	694,342,185.88	79.96%	173,971,986.06	20.04%
国投瑞银瑞和小 康沪深300指数	4707	57,224.88	156,385,774.00	58.06%	112,971,726.00	41.94%
国投瑞银瑞和远 见沪深300指数	5378	50,085.07	97,672,094.00	36.26%	171,685,406.00	63.74%
合计	18,273	77,000.45	948,400,053.88	67.40%	458,629,118.06	32.60%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

国投瑞银瑞和小康沪深300指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总 份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	45,601,311.00	16.93%

2	生命人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	24,189,150.00	8.98%
3	中国人寿保险（集团）公司	19,573,769.00	7.27%
4	永安财产保险股份有限公司	15,622,965.00	5.80%
5	兴业国际信托有限公司—福建中行新股申购资金信托项目5期	15,539,436.00	5.77%
6	西南证券股份有限公司	10,397,142.00	3.86%
7	詹美华	9,894,998.00	3.67%
8	深圳市琛达投资有限公司	5,949,236.00	2.21%
9	山西信托有限责任公司	5,076,681.00	1.88%
10	黄雪林	3,951,150.00	1.47%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

#### 国投瑞银瑞和远见沪深300指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	35,035,943.00	13.01%
2	生命人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	24,189,104.00	8.98%
3	新华人寿保险股份有限公司	14,725,259.00	5.47%
4	天安保险股份有限公司	6,958,854.00	2.58%
5	深圳市琛达投资有限公司	5,949,236.00	2.21%
6	中国银河证券股份有限公司	4,207,176.00	1.56%
7	孙爱平	3,936,498.00	1.46%
8	秦明伟	3,149,217.00	1.17%
9	杨舰	2,910,000.00	1.08%
10	田明华	2,880,000.00	1.07%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员	国投瑞银瑞和沪深300指数	545,824.49	0.06%
	国投瑞银瑞和小康沪深300指数	—	—

持有本开放式基金	国投瑞银瑞和远见沪深300指数	—	—
	合计	545,824.49	0.04

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国投瑞银瑞和沪深300指数	国投瑞银瑞和小康沪深300指数	国投瑞银瑞和远见沪深300指数
基金合同生效日(2009年10月14日)基金份额总额	257,188,522.99	1,479,367,342.00	1,479,367,342.00
本报告期期初基金份额总额	774,555,333.05	799,690,916.00	799,690,916.00
本报告期期间基金总申购份额	987,170,308.40	6,847,593.00	6,847,593.00
减：本报告期基金总赎回份额	745,174,290.49	441,503,636.00	441,503,636.00
本报告期基金拆分变动份额	-148,237,179.02	-95,677,373.00	-95,677,373.00
本报告期期末基金份额总额	868,314,171.94	269,357,500.00	269,357,500.00

注：1、总申购份额含配对转换转入份额，总赎回份额含配对转换转出份额。

2、本基金于2011年10月13日根据基金合同的规定进行了基金份额折算。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金连续提供审计服务3年。报告期内应支付给该事务所的报酬为100,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	446,994,806.14	12.93%	—	—	379,945.43	13.11%	
瑞银证券	2	342,106,828.46	9.90%	6,399.40	0.10%	279,312.70	9.64%	
中信证券	2	338,777,224.01	9.80%	—	—	287,961.69	9.93%	
华泰联合证券	1	219,804,754.88	6.36%	674,182.60	10.75%	186,834.12	6.45%	
民生证券	1	191,275,724.60	5.53%	—	—	162,583.83	5.61%	
东方证券	1	171,372,035.15	4.96%	194,445.30	3.10%	145,665.29	5.02%	
申银万国	1	170,578,382.36	4.93%	—	—	138,596.17	4.78%	
海通证券	2	168,197,517.96	4.87%	5,380,721.00	85.83%	141,823.20	4.89%	
长江证券	1	167,585,790.36	4.85%	—	—	142,447.69	4.91%	新增
齐鲁证券	1	166,311,637.09	4.81%	—	—	141,364.69	4.88%	
安信证券	3	153,828,787.20	4.45%	—	—	127,721.30	4.41%	
华创证券	1	127,693,298.69	3.69%	—	—	103,751.84	3.58%	新增
南京证券	1	107,755,653.88	3.12%	13,527.00	0.22%	91,592.87	3.16%	新增
招商证券	1	100,970,085.42	2.92%	—	—	82,038.90	2.83%	
国金证券	1	84,211,395.61	2.44%	—	—	68,422.10	2.36%	
银河证券	2	75,536,957.40	2.18%	—	—	64,206.47	2.21%	

中信建投证券	3	74,124,171.74	2.14%	—	—	63,004.96	2.17%	
华融证券	1	71,900,062.46	2.08%	—	—	61,115.40	2.11%	
平安证券	1	58,952,501.36	1.71%	—	—	50,109.48	1.73%	
东海证券	1	55,175,711.12	1.60%	—	—	44,830.42	1.55%	新增
国元证券	1	48,207,637.82	1.39%	—	—	40,976.41	1.41%	
广发证券	1	47,988,838.33	1.39%	—	—	38,991.15	1.35%	
广州证券	1	42,331,484.43	1.22%	—	—	34,394.47	1.19%	
国信证券	1	8,929,557.94	0.26%	—	—	7,255.45	0.25%	
中银国际	1	8,237,830.00	0.24%	—	—	7,002.17	0.24%	
信达证券	1	4,984,408.33	0.14%	—	—	4,049.86	0.14%	
西部证券	1	2,229,650.00	0.06%	—	—	1,895.19	0.07%	
山西证券	1	1,192,300.00	0.03%	—	—	968.72	0.03%	

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期未发生交易所回购及权证交易。

3、除上表列示交易单元外，本基金本报告期延续租用华泰证券、高华证券、中投证券、华宝证券、东吴证券各1个交易单元，并新增租用东北证券及东兴证券各1个交易单元。上述交易单元本期均未发生交易量。

国投瑞银基金管理有限公司  
二〇一二年三月二十九日