

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金2012年半年度报告摘要

2012年06月30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08月27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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

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>上市契约型开放式。</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	918,283,686.64		
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	464,464,752.64	226,909,467.00	226,909,467.00

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资

	<p>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
	联系电话	400-880-6868
	电子邮箱	service@ubssdic.com
客户服务电话	400-880-6868	95588
传真	0755-82904048	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012年01月01日-2012年06月30日）
本期已实现收益	-174,964,131.19
本期利润	72,171,711.89
加权平均基金份额本期利润	0.0587
本期基金份额净值增长率	5.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.3596
期末基金资产净值	862,949,506.33
期末基金份额净值	0.940

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

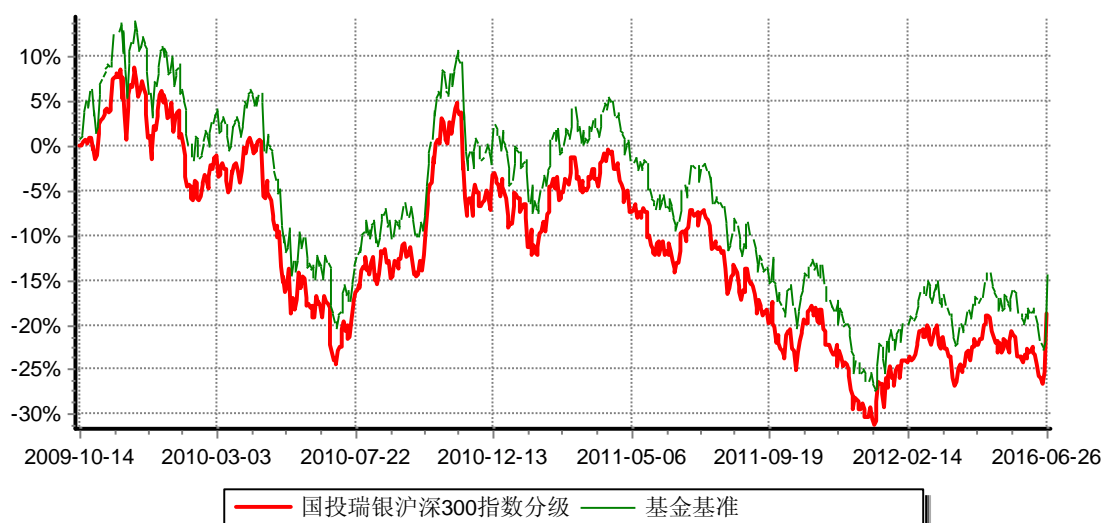
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.05%	1.02%	-6.15%	1.04%	1.10%	-0.02%
过去三个月	1.40%	1.06%	0.29%	1.07%	1.11%	-0.01%
过去六个月	5.50%	1.25%	4.76%	1.26%	0.74%	-0.01%
过去一年	-17.74%	1.27%	-18.16%	1.28%	0.42%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-25.44%	1.36%	-21.69%	1.37%	-3.75%	-0.01%

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94.49%，权证投资占基金净值比例0%，债券投资占基金净值比例4.49%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例5.32%，符合基金合同的相关规定。

§ 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，注册地上海。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154人，其中92人具有硕士或博士学位。截止2012年6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员、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。曾任国投瑞银新兴市场基金（QDII-LOF）基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，由于本指数基金被动调仓需要，本基金与管理人管理的国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金在参与交易所公开竞价同日反向时，出现1次交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%。除此之外，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合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成交量5%的情况，也未发现异常交易行为。

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

2012年上半年，中国经济增速继续放缓，根据最新公布的经济数据，2季度中国GDP同比增长7.6%，增速比1季度回落0.5个百分点，而环比增长1.8%，较1季度回升0.2个百分点。从单月经济指标来看，经济增长增速也出现一些企稳的迹象，其中工业增加值在4月份同比、环比增速达到上半年的低点，而后出现一定幅度的回升。伴随着需求回落、大

大宗商品价格大幅调整，通胀压力大幅缓解，6月份CPI同比增速回落到2.2%，而PPI同比增速连续4个月陷入负增长。随着通胀回落，央行货币政策大幅宽松，上半年下调存款准备金率两次合计1个百分点，在6月份之后降息两次合计50bp,货币增速自底部略有回升。

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，积极应对成份股调整、成份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0.940元，本报告期份额净值增长率为5.50%，同期业绩基准增长率为4.76%，基金净值增长率超过同期业绩基准0.74%，主要来源于成份股替代停牌等市场优化机会、指数成份股调整、基金的申购赎回影响、以及其他利息股息收入等。报告期内，日均跟踪误差为0.06%，年化跟踪误差为0.97%，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 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然统计局公布的2季度GDP数据验证了我们前期关于本轮经济增长环比低点有较大可能出现在1季度的判断，但本轮经济周期中国经济调整的时间和复杂程度仍超出我们的预期。展望2012年下半年，随着年初以来实施的各项稳增长政策逐步发生效用，投资和消费同比增速有望低位企稳并略有回升，通胀压力进一步缓解，货币政策将更为宽松。

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。

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

2012年上半年，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、净值计算等情况的说明

2012年上半年，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 托管人对本半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2012年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2012年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年06月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产：			

银行存款		5,531,302.42	14,429,070.06
结算备付金		1,598,210.55	—
存出保证金		517,881.50	896,831.42
交易性金融资产		854,130,097.44	1,237,159,677.22
其中：股票投资		815,366,097.44	1,187,999,677.22
基金投资		—	—
债券投资		38,764,000.00	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		1,033,942.92	2,682,461.04
应收利息		843,323.67	772,181.24
应收股利		1,192,867.68	—
应收申购款		31,320.75	72,655.47
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		864,878,946.93	1,256,012,876.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年06月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债：			
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		76,245.23	133,338.91
应付管理人报酬		902,986.53	1,100,870.24
应付托管费		198,657.00	242,191.44
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		552,381.25	243,161.20
应交税费		—	—

应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		199,170.59	100,491.30
负债合计		1,929,440.60	1,820,053.09
所有者权益：			
实收基金		1,157,623,551.27	1,773,776,085.79
未分配利润		-294,674,044.94	-519,583,262.43
所有者权益合计		862,949,506.33	1,254,192,823.36
负债和所有者权益总计		864,878,946.93	1,256,012,876.45

注：报告截止日2012年6月30日，国投瑞银瑞和沪深300指数份额净值0.940元，国投瑞银瑞和小康沪深300指数份额净值0.940元，国投瑞银瑞和远见沪深300指数份额净值0.940元；基金份额总额918,283,686.64份，其中国投瑞银瑞和沪深300指数份额464,464,752.64份，国投瑞银瑞和小康沪深300指数份额226,909,467.00份，国投瑞银瑞和远见沪深300指数份额226,909,467.00份。

6.2 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：2012年01月01日-2012年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2012年01月01日-2012年06月30日	上年度可比期间2011年01月01日-2011年06月30日
一、收入		81,834,746.90	-32,278,653.69
1.利息收入		849,085.54	448,432.14
其中：存款利息收入		81,378.70	441,869.15
债券利息收入		767,706.84	6,562.99
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）		-166,679,708.86	-15,122,449.50

其中：股票投资收益		-179,424,296.97	-31,873,647.55
基金投资收益		—	—
债券投资收益		42,670.00	397,927.47
资产支持证券投资收 益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益		12,701,918.11	16,353,270.58
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）		247,135,843.08	-18,083,044.84
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填 列）		529,527.14	478,408.51
减：二、费用		9,663,035.01	15,996,414.94
1. 管理人报酬		5,920,042.52	10,572,740.45
2. 托管费		1,302,409.33	2,326,002.96
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		2,231,720.68	2,889,486.48
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用		208,862.48	208,185.05
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		72,171,711.89	-48,275,068.63
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		72,171,711.89	-48,275,068.63

6.3 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：2012年01月01日-2012年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2012年01月01日-2012年06月30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)	1,773,776,085.79	-519,583,262.43	1,254,192,823.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	72,171,711.89	72,171,711.89
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)	-616,152,534.52	152,737,505.60	-463,415,028.92
其中：1.基金申购款	159,008,602.27	-12,891,530.19	146,117,072.08
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-775,161,136.79	165,629,035.79	-609,532,101.00
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)	1,157,623,551.27	-294,674,044.94	862,949,506.33
项 目	上年度可比期间		
	2011年01月01日-2011年06月30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)	—	-48,275,068.63	-48,275,068.63
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)	-323,576,592.72	16,234,977.24	-307,341,615.48
其中：1.基金申购款	525,009,178.03	-5,555,477.40	519,453,700.63
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-848,585,770.75	21,790,454.64	-826,795,316.11
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)	2,156,637,092.93	-202,587,961.23	1,954,049,131.70
---------------------	------------------	-----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 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,本基金将以年阈值(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元的部分划分成年阈值以内和年阈值以外的两个部分,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阈值以内的部分,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阈值以外的部分,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： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年半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2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

于2012年上半年度，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2012年01月01日-2012年 06月30日	上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月

		30日
当期应支付的管理费	5,920,042.52	10,572,740.45
其中：应支付给销售机构的客户维护费	273,748.71	357,482.29

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2012年01月01日-2012年06月30日	上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月30日
当期应支付的托管费	1,302,409.33	2,326,002.96

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2012 年 01 月 01 日 -2012 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 01 月 01 日-2011 年 06 月 30 日
国投瑞银瑞和沪深 300 指数		
期初持有的基金份额	7,937,628.88	9,577,988.75
期间申购/买入总份额		
期间因折算变动份额		
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	1.71%	1.11%

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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2012年01月01日-2012年06月30日		上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月30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	5,531,302.42	73,403.83	107,330,309.54	435,231.23

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间，无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.9 期末（2012年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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	期末 成本总额	期末 估值总额
000059	辽通化工	2012-06-26	非公开发行	7.91	2012-07-03	8.15	164548	1,961,656.98	1,301,574.68
002500	山西证券	2012-05-15	发行股份购买资产	8.19			52200	432,359.00	427,518.00

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本期末未持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	815,366,097.44	94.28
	其中：股票	815,366,097.44	94.28
2	固定收益投资	38,764,000.00	4.48
	其中：债券	38,764,000.00	4.48
	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	7,129,512.97	0.82
6	其他各项资产	3,619,336.52	0.42
7	合计	864,878,946.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,445,493.17	0.17
B	采掘业	81,452,042.61	9.44
C	制造业	285,002,539.91	33.03
C0	食品、饮料	64,584,906.24	7.48
C1	纺织、服装、皮毛	4,107,129.06	0.48
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	17,399,002.46	2.02
C5	电子	10,907,196.93	1.26
C6	金属、非金属	57,825,601.66	6.70
C7	机械、设备、仪表	96,814,353.73	11.22
C8	医药、生物制品	32,659,180.81	3.78
C99	其他制造业	705,169.02	0.08

D	电力、煤气及水的生产和供应业	21,497,235.85	2.49
E	建筑业	30,849,987.38	3.57
F	交通运输、仓储业	22,777,238.72	2.64
G	信息技术业	21,544,560.63	2.50
H	批发和零售贸易	23,230,226.26	2.69
I	金融、保险业	261,063,380.29	30.25
J	房地产业	43,448,861.95	5.03
K	社会服务业	8,647,198.79	1.00
L	传播与文化产业	1,704,530.90	0.20
M	综合类	12,702,800.98	1.47
	合计	815,366,097.44	94.49

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	601318	中国平安	661,743	30,268,124.82	3.51
2	600016	民生银行	4,500,989	26,960,924.11	3.12
3	600036	招商银行	2,281,707	24,916,240.44	2.89
4	601328	交通银行	5,342,669	24,255,717.26	2.81
5	601166	兴业银行	1,646,267	21,368,545.66	2.48
6	600519	贵州茅台	76,947	18,401,875.05	2.13
7	600000	浦发银行	2,146,372	17,450,004.36	2.02
8	600837	海通证券	1,787,437	17,213,018.31	1.99
9	000002	万科A	1,797,931	16,019,565.21	1.86
10	600030	中信证券	1,259,932	15,912,941.16	1.84

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>）的半年度报告正文。

7.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	10,310,475.87	0.82
2	000629	攀钢钒钛	10,188,947.51	0.81
3	600111	包钢稀土	10,023,781.15	0.80
4	600383	金地集团	9,839,980.10	0.78
5	601328	交通银行	7,805,403.00	0.62
6	601818	光大银行	7,411,273.00	0.59
7	000776	广发证券	7,328,474.12	0.58
8	601600	中国铝业	7,215,541.56	0.58
9	600011	华能国际	5,853,371.14	0.47
10	002036	宜科科技	5,177,546.04	0.41
11	601166	兴业银行	4,696,947.40	0.37
12	000895	双汇发展	4,630,659.92	0.37
13	600104	上汽集团	4,620,251.38	0.37
14	000858	五粮液	4,603,473.14	0.37
15	601668	中国建筑	4,594,809.00	0.37
16	600362	江西铜业	4,581,730.52	0.37
17	002202	金风科技	4,516,555.00	0.36
18	600030	中信证券	4,408,966.45	0.35
19	600837	海通证券	4,406,602.75	0.35
20	000063	中兴通讯	4,225,528.28	0.34

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。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	18,501,138.29	1.48

2	600036	招商银行	17,791,408.37	1.42
3	600016	民生银行	16,951,095.33	1.35
4	601318	中国平安	16,794,869.92	1.34
5	601939	建设银行	14,861,585.99	1.18
6	000002	万科A	13,344,492.43	1.06
7	600030	中信证券	13,343,532.33	1.06
8	601166	兴业银行	12,581,663.87	1.00
9	601601	中国太保	12,237,887.63	0.98
10	000858	五粮液	11,877,838.12	0.95
11	601328	交通银行	11,736,785.33	0.94
12	000063	中兴通讯	11,454,765.33	0.91
13	600383	金地集团	11,402,737.28	0.91
14	600111	包钢稀土	10,856,613.65	0.87
15	600000	浦发银行	10,387,765.03	0.83
16	601088	中国神华	10,087,004.56	0.80
17	600837	海通证券	9,933,218.36	0.79
18	601668	中国建筑	8,827,099.80	0.70
19	601288	农业银行	8,647,598.77	0.69
20	000776	广发证券	8,522,180.98	0.68

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	434,808,238.27
卖出股票收入（成交）总额	875,068,054.16

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。

7.5 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	38,764,000.00	4.49
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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	38,764,000.00	4.49

7.6 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	1101088	11央行票据 88	400,000	38,764,000.00	4.49

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	517,881.50
2	应收证券清算款	1,033,942.92
3	应收股利	1,192,867.68

4	应收利息	843,323.67
5	应收申购款	31,320.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,619,336.52

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 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。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	7,851	59,159.95	295,033,896 .22	63.52%	169,430,856 .40	36.48%
国投瑞银 瑞和小康	4,382	51,782.17	122,549,042 .00	54.01%	104,360,425 .00	45.99%

沪深300 指数						
国投瑞银 瑞和远见 沪深300 指数	4,902	46,289.16	82,640,110. 00	36.42%	144,269,357 .00	63.58%
合计	17,135	53,591.11	500,223,048 .22	54.47%	418,060,638 .40	45.53%

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。

8.2 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	33,186,000	14.63%
2	生命人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	24,188,000	10.66%
3	中国人寿保险（集团）公司	19,573,769	8.63%
4	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	6.85%
5	兵工财务有限责任公司	13,161,776	5.80%
6	詹美华	9,894,998	4.36%
7	山西信托有限责任公司	5,076,681	2.24%
8	黄雪林	3,951,150	1.74%
9	中海信托股份有限公司—新股约定申购资金信托(8)	2,427,947	1.07%
10	合众人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	2,374,106	1.05%

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	15.44%
2	生命人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	24,188,000	10.66%
3	新华人寿保险股份有限公司	11,657,168	5.14%
4	天安保险股份有限公司	6,958,854	3.07%
5	孙爱平	3,936,498	1.73%
6	王静	2,890,625	1.27%
7	叶海龙	2,517,915	1.11%
8	贾玲玲	2,486,210	1.10%
9	姚德怀	2,390,120	1.05%
10	五矿资本控股有限公司	1,983,594	0.87%

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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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持有本基金	国投瑞银瑞和沪深300指数	604,846.67	0.13%
	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	—	—
	合计	604,846.67	0.07%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金国投瑞银瑞和沪深300指数份额总量的数量区间为10万份至50万份（含）。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 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	868,314,171.94	269,357,500.00	269,357,500.00
本报告期基金总申购份额	125,602,372.42	260,889.00	260,889.00
减：本报告期基金总赎回份额	529,451,791.72	42,708,922.00	42,708,922.00
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	464,464,752.64	226,909,467.00	226,909,467.00

注：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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金继续聘请普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务，未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 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。

10.7 本期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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	329,259,891.32	25.16%	280,760.37	25.42%	新增
申银万国	1	170,172,562.20	13.00%	138,950.76	12.58%	
高华证券	1	139,597,351.47	10.67%	118,658.33	10.74%	
中信建投证券	3	119,751,136.74	9.15%	101,942.29	9.23%	
银河证券	2	83,629,006.59	6.39%	72,430.91	6.56%	
中金公司	1	77,619,802.51	5.93%	65,977.35	5.97%	
中信证券	2	67,269,882.16	5.14%	57,179.65	5.18%	

山西证券	1	65,372,243.54	5.00%	53,115.31	4.81%	
国海证券	1	40,645,367.06	3.11%	33,788.41	3.06%	新增
民生证券	1	33,137,715.62	2.53%	28,166.97	2.55%	
南京证券	1	29,034,900.92	2.22%	24,679.36	2.23%	
东北证券	1	24,381,109.48	1.86%	20,105.44	1.82%	
国元证券	2	22,028,741.01	1.68%	19,231.05	1.74%	新增1个
国金证券	1	21,729,979.59	1.66%	17,864.28	1.62%	
瑞银证券	2	17,687,118.88	1.35%	15,359.38	1.39%	
国信证券	1	15,748,971.60	1.20%	13,263.19	1.20%	
东兴证券	1	11,258,101.72	0.86%	9,147.09	0.83%	
平安证券	1	10,513,746.52	0.80%	9,155.47	0.83%	
华创证券	1	8,871,528.50	0.68%	7,208.14	0.65%	
东海证券	1	5,657,316.34	0.43%	4,596.57	0.42%	
安信证券	3	4,943,165.00	0.38%	4,016.24	0.36%	
齐鲁证券	1	3,614,142.40	0.28%	3,072.11	0.28%	
中投证券	1	3,003,169.10	0.23%	2,440.06	0.22%	
东方证券	1	1,929,000.00	0.15%	1,639.51	0.15%	
海通证券	2	1,883,200.00	0.14%	1,596.01	0.14%	

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债券、交易所回购及权证交易。

3、除上表列示交易单元外，本基金本报告期新增租用长城证券1个交易单元。并延续租用长江证券、东吴证券、广发证券、广州证券、华宝证券、华融证券、华泰联合证券、华泰证券、西部证券、信达证券、招商证券及中银国际证券各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

二〇一二年八月二十七日