国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）2012年半年度报告

2012年6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8月27日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 7
2.6 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
说明 13
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 41
7.7 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 41
7.8 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 42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 42
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 42
7.11 投资组合报告附注 42
§8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.2 期末上市基金前十名持有人 43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 44
10.1 基金份额持有人大会决议 44
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 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况 44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 45
10.8 其他重大事件 46
§11 备查文件目录 46
11.1 备查文件目录 46
11.2 存放地点 46
11.3 查阅方式 46

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	国投瑞银新兴市场股票(QDII－LOF)(场内简称:国投新兴)
基金主代码	161210
基金交易代码	161210
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月10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	76,761,121.83 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	2010年7月1日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球新兴市场国家或者地区，通过对投资对象的精选和组合投资，分散投资风险，力求实现基金资产的中长期稳定增值。 本基金投资于注册地或者主要经济活动在全球新兴市场国家或者地区的公司或者组织发行的证券。“主要经济活动在全球新兴市场国家或者地区”指主营业务收入或利润的至少50%来自于全球新兴市场国家或者地区；“全球新兴市场国家或者地区”指MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）成份中包含的国家或者地区。
投资策略	本基金将采取积极的股票投资管理策略，充分借鉴UBS Global AM 的全球投资管理经验，在辅助性地考

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	虑类别资产配置、国别或区域配置等因素的基础上，主要通过精选具有国际竞争力或高成长性的全球新兴市场优质企业和严谨的风险控制管理下的组合构建及调整，力求实现基金资产的中长期稳定增长。
业绩比较基准	摩根士丹利资本国际新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index（Net Total Return））
风险收益特征	本基金为全球投资股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益水平高于债券型基金和混合型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。但是，本基金主要投资于全球新兴市场的证券，因此具有较大的新兴市场投资所面临的特定风险。

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
注册地址		上海市虹口区东大名路638号7层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518035	100140
法定代表人		钱蒙	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	UBS Global Asset Management (Singapore) Ltd	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	中文	瑞银环球资产管理（新加坡）有限公司	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		One Raffles Quay, #50-01 North Tower, Singapore 048583	香港中环德辅道中4-4A渣打银行大厦三十二楼
办公地址		One Raffles Quay, #50-01 North Tower, Singapore 048583	香港九龙，官塘，官塘道388号，渣打中心十五
邮政编码		Singapore 048583	—

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012年1月1日-2012年6月30日）
本期已实现收益	-976,827.80
本期利润	2,657,168.08
加权平均基金份额本期利润	0.0341
本期加权平均净值利润率	3.65%
本期基金份额净值增长率	8.64%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012年6月30日）
期末可供分配利润	-7,287,688.60
期末可供分配基金份额利润	-0.0949
期末基金资产净值	69,473,433.23
期末基金份额净值	0.905
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-9.50%

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	5.72%	1.53%	3.25%	1.36%	2.47%	0.17%
过去三个月	-6.99%	1.24%	-9.56%	1.09%	2.57%	0.15%
过去六个月	8.64%	1.14%	2.68%	1.03%	5.96%	0.11%
过去一年	-14.62%	1.52%	-20.08%	1.42%	5.46%	0.10%
自基金合同生效起至今	-9.50%	1.21%	-3.01%	1.20%	-6.49%	0.01%

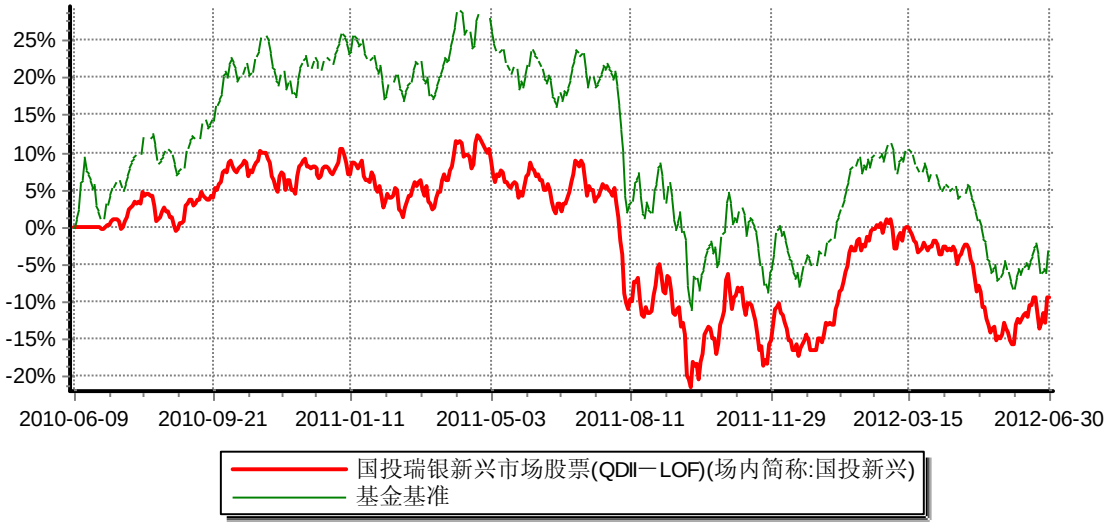
注：1、本基金业绩比较基准为MSCI Emerging Markets Index （Net Total Return），即摩根士丹利资本国际新兴市场指数，是按照自由流通市值调整方法并考虑净红利再投资的全回报（Total return）因素编制的跟踪全球新兴市场的全球性投资指数，是适合作为全球新兴市场投资业绩比较基准的指数。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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及存托凭证投资占基金净值比例96.18%，权证投资占基金净值比例0%，债券投资占基金净值比例0%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例4.22%。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	2010年6月10日	2012年3月10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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	业务部副总监				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。现任国投瑞银瑞和沪深300指数分级基金基金经理。
汤海波	本基金基金经理	2012年3月10日	—	13	中国籍，硕士，具有基金从业资格。美国特许金融分析师（CFA）。曾任职于华安基金、摩根大通证券、美林证券、中信资本投资研究有限公司。2010年7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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Yit-Mee Cheah	瑞银环球资产管理（新加坡）有限公司董事总经理，兼任新兴市场及亚太地区组合经理	22	毕业于新加坡国立大学，美国特许金融分析师（CFA）
Bin Shi（施斌）	亚洲（不含日本）投资组合经理	18	毕业于美国Tulane大学，美国特许金融分析师（CFA）
Geoffrey Wong Ee Kay	瑞银环球资产管理（新加坡）有限公司董事总经理、投资负责人、兼任全球新兴市场及亚太地区股票投资研究主管	24	毕业于美国麻省理工学院，美国特许金融分析师（CFA）

4.3 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为，也未出现与管理人管理的其他所有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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年上半年，新兴市场股市总体呈现冲高回落的走势。年初，欧洲债务危机显著缓解，美国经济数据表现强劲，新兴市场国家通胀压力缓解，新兴市场股市因此大幅上涨。但是二季度以来，欧债风险重新抬头，美国经济复苏形势反复，而以中国为代表的新兴市场国家经济增速大幅放缓，新兴市场股市则逐步回落，至5月份因为欧债危机的加剧而大幅下跌。6月份以后随着中国降息以及希腊大选局势的明朗，新兴市场股市又见底回升。MSCI新兴市场指数（人民币计价，下同）上半年累计上涨2.68%，主要新兴市场地区中，印度和韩国表现较好，分别涨8.55%和5.47%；巴西和印尼表现较差，分别跌9.18%和4.03%。

欧债危机是上半年市场关注的焦点。年初受益于欧洲央行的长期再融资操作以及对希腊救助的顺利进行，欧债风险大幅下降。但是二季度后，希腊大选的波折、法国左翼总统的上台以及西班牙银行危机等一系列事件使得欧债风险再次大幅攀升。受投资者避险情绪的影响，包括新兴市场在内的各类风险资产被大幅抛售。但6月中旬以后，随着西班牙接受救助以及希腊支持救助计划的政党获得大选胜利，欧债危机的风险开始出现缓和。美国方面，经过一季度的强劲表现之后，美国经济数据在二季度也明显走弱，主要表现在非农就业以及PMI等关键数据总体低于市场预期，但房地产市场则初现筑底企稳迹象。美国联储在6月底将2012年的增长预期从2.4-2.9%大幅下调到1.9-2.4%，但在政

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

策上继续保持谨慎，仅仅是延长扭曲操作，并未推出新一轮的量化宽松。

新兴市场方面，主要国家和地区经济增长持续放缓，同时通胀压力显著下降，宏观政策也随之放松。中国4月份宏观数据以及5月份的PMI数据大幅低于预期，令投资者再次看淡中国的增长前景，对大宗商品出口依赖较高的巴西也受到一定冲击。俄罗斯股市则受到油价下跌以及资本外流的负面影响而大幅下跌。另一方面，政策放松的步伐更加明显，期间中国、巴西、印度、印尼等主要新兴市场国家均多次下调基准利率或存款准备金率，表明随着通胀压力的显著缓解，新兴市场国家已经具有更大的空间以及更强的意愿来采取宽松的货币政策以支持经济增长。

上半年我们的投资组合继续专注于股票选择上，国家和行业的组合占比主要是自下而上选股方式的结果。在选股上我们避免全球周期性股票，更倾向于主营业务在新兴市场内部的个股，以使组合在动荡时期具有较好的防御性。我们维持低配全球周期性行业，如能源、原材料和制造业等，超配内需驱动的防御性行业，如电信，消费品行业等。

4.5.2 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0.905元，本报告期份额净值上涨8.64%，同期MSCI新兴市场指数（按人民币计价）上涨2.68%，超额收益为5.96%，主要来自于自下而上个股选择的贡献，以及对能源和原材料行业的低配。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来，欧债危机带来的抛售压力超过我们的预期，尽管在季度末欧债危机再现转机，然而考虑到多边政治的复杂性，未来仍有出现反复的可能，市场波动也在所难免。而美国经济虽然有所走弱，但房地产市场初现见底迹象，同时其经济的去杠杆化也取得了显著进展，因此我们预期其经济表现仍可望保持平稳，有助于稳定全球投资者的信心。新兴市场内部，我们相信随着政策放松效应的逐步体现，新兴市场国家的宏观数据在未来几个月中有望逐步改善，从而给股市表现带来支撑。风险因素包括：欧债危机重新蔓延可能性仍在；新兴市场国家经济增长下滑幅度超出预期。

4.7 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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。

4.8 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-976,827.80元，期末可供分配利润为-7,287,688.60元。

本基金本报告期未进行收益分配。

§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全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）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

2012年上半年，国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）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。

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全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）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：国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2012年6月30日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,934,620.50	1,885,065.08
结算备付金		—	—
存出保证金		93,750.00	93,750.00
交易性金融资产	6.4.7.2	66,817,559.99	51,008,185.30
其中：股票投资		66,817,559.99	51,008,185.30
基金投资			—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	343.20	261.47
应收股利		302,560.21	73,849.16
应收申购款		22,362.74	13,937.17
递延所得税资产			—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		70,171,196.64	53,075,048.18
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2012年6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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	75,449.95
应付赎回款		365,478.00	131,116.38
应付管理人报酬		99,949.13	82,948.12

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

应付托管费		19,434.54	16,128.79
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	—	—
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债			—
其他负债	6.4.7.8	212,901.74	60,492.55
负债合计		697,763.41	366,135.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	76,761,121.83	63,269,932.13
未分配利润	6.4.7.10	-7,287,688.60	-10,561,019.74
所有者权益合计		69,473,433.23	52,708,912.39
负债和所有者权益总计		70,171,196.64	53,075,048.18

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.905元，基金份额总额76,761,121.83份。

6.2 利润表

会计主体：国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6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		3,723,027.17	-130,564.11
1.利息收入		13,508.69	22,397.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,508.69	22,397.76
债券利息收入		—	—
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		—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2.投资收益（损失以“-”填列）		75,722.64	3,543,657.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-783,248.28	2,618,734.64
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	858,970.92	924,922.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,633,995.88	-3,620,591.98
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-28,884.54	-119,725.12
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,684.50	43,697.62
减：二、费用		1,065,859.09	1,086,381.06
1．管理人报酬		646,976.12	644,391.40
2．托管费		125,800.90	125,298.33
3．销售服务费		—	—
4．交易费用	6.4.7.18	79,615.39	108,223.25
5．利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6．其他费用	6.4.7.19	213,466.68	208,468.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,657,168.08	-1,216,945.17
减：所得税费用			
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,657,168.08	-1,216,945.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年6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)	63,269,932.13	-10,561,019.74	52,708,912.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	2,657,168.08	2,657,168.08
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）	13,491,189.70	616,163.06	14,107,352.76
其中：1.基金申购款	39,982,184.97	-740,880.99	39,241,303.98
2.基金赎回款	-26,490,995.27	1,357,044.05	-25,133,951.22
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）	76,761,121.83	-7,287,688.60	69,473,433.23
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)	68,292,254.60	5,876,173.14	74,168,427.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,216,945.17	-1,216,945.17
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）	1,683,762.20	-457,827.82	1,225,934.38
其中：1.基金申购款	34,029,033.50	2,233,681.61	36,262,715.11
2.基金赎回款	-32,345,271.30	-2,691,509.43	-35,036,780.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	69,976,016.80	4,201,400.15	74,177,416.95

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

国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)(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]第1375号《关于核准国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)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《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币443,102,169.08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(2010)第141号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年6月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为443,165,098.58份基金份额，其中认购资金利息折合62,929.50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，境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)，境外投资顾问为瑞银环球资产管理(新加坡)有限公司(UBS Global Asset Management (Singapore) Limited)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第210号文审核同意，本基金117,823,038.00份基金份额于2010年7月1日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为股票、固定收益证券、银行存款和法律法规允许的其他投资工具。本基金投资范围包括注册地或者主要经济活动在全球新兴市场国家或者地区的公司或者组织发行的证券。“主要经济活动在全球新兴市场国家或者地区”指主营业务收入或利润的至少50%来自于全球新兴市场国家或者地区；“全球新兴市场国家或者地区”指MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）成份中包含的国家或者地区。在正常市场情况下，本基金各类资产配置的比例范围是：股票资产占基金资产的60%-100%，债券和其他资产占基金资产的0%-40%。本基金的业绩比较基准为：摩根士丹利资本国际新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index (Net Total Return))。

6.4.2 会计报表的编制基础

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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》、《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金(LOF)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 会计政策和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

本基金本报告期无会计差错更正。

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	2,934,620.50
定期存款	—
其他存款	—
合计	2,934,620.50

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

注：2012年6月30日，活期存款包括人民币活期存款1,460,106.15元，美元活期存款233,127.66元(折合人民币1,474,509.07元)，港币活期存款3.26元(折合人民币2.63元) 和韩元活期存款484.00元（折合人民币2.65元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		74,697,949.49	66,817,559.99	-7,880,389.50
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		74,697,949.49	66,817,559.99	-7,880,389.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	343.20
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	343.20

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末未有应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
预提审计费	32,820.06
预提信息披露费	149,179.94
预提上市年费	29,835.26
应付赎回费	1,066.48
合计	212,901.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,269,932.13	63,269,932.13
本期申购	39,982,184.97	39,982,184.97
本期赎回（以“-”号填列）	-26,490,995.27	-26,490,995.27
本期末	76,761,121.83	76,761,121.83

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,284,072.68	-12,845,092.42	-10,561,019.74
本期利润	-976,827.80	3,633,995.88	2,657,168.08
本期基金份额交易产生的变动数	577,947.42	38,215.64	616,163.06
其中：基金申购款	1,304,911.79	-2,045,792.78	-740,880.99
基金赎回款	-726,964.37	2,084,008.42	1,357,044.05

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,885,192.30	-9,172,880.90	-7,287,688.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	13,463.66
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	45.03
合计	13,508.69

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	11,188,035.69
减：卖出股票成本总额	11,971,283.97
买卖股票差价收入	-783,248.28

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	858,970.92

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

基金投资产生的股利收益	—
合计	858,970.92

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	3,633,995.88
——股票投资	3,633,995.88
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	3,633,995.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	28,681.88
其他收入	2.62
合计	28,684.50

注：本基金场外份额的赎回费率按持有期间递减，场内份额的赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	79,615.39

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

银行间市场交易费用	—
合计	79,615.39

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	32,820.06
信息披露费	149,179.94
其他费用	1,422.92
银行汇划费	208.50
上市费	29,835.26
合计	213,466.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告送出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)	境外资产托管人
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东

注：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。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
瑞士银行股份有限公司	3,157,708.69	8.94%	8,621,225.00	14.68%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
瑞士银行股份有限公司	1,733.59	3.32%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
瑞士银行股份有限公司	3,009.94	4.56%		—

注：上述佣金按每笔交易的实际佣金率计算。实际佣金率在佣金协议约定的范围内，并受到每笔交易的集合交易量影响。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至	上年度可比期间 2011年01月01日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	2012年6月30日	-2011年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	646,976.12	644,391.40
其中：支付给销售机构的客户维护费	191,315.05	183,530.49

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1.80%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 × 1.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年01月01日 -2011年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	125,800.90	125,298.33

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0.35%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 × 0.35% / 当年天数。

6.4.10.3 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银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月30日
期初持有的基金份额	10,002,150.00	10,002,150.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,002,150.00	10,002,150.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	13.03%	14.29%

6.4.10.4.2 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本基金本期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年01月01日-2011年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,460,318.98	12,542.41	2,285,112.28	21,150.61
渣打银行(香港)有限公司	1,474,301.52	921.25	1,902,183.67	1,070.38

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人渣打银行(香港)有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资海外证券的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括括股票、固定收益证券、银行存款和法律法规或中国证监会允许的其他投资工具。本基金在日常经营活动中面临的与这

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过对投资对象的精选和组合投资，分散投资风险，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

本基金的基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

6.4.13.2信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行以及境外次托管行渣打银行(香港)有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2012年6月30日，本基金未持有债券(2011年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人持续进行本基金的流动性需求分析，构建投资组合时，对备选证券进行流动性检验，并以适度分散策略保持组合流动性，严格控制缺乏流动性资产的比例。同时通过独立的风险管理部门设定基金的流动性比例控制要求，对现金类资产配置策略、股票集中度、重仓证券的流动性以及冲击成本率、换手率和交易活跃度等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值10%，且本基金的基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金所

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人执行灵活的利率管理策略规避利率风险，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,934,620.50	—	—	—	2,934,620.50
存出保证金	—	—	—	93,750.00	93,750.00
交易性金融资产	—	—	—	66,817,559.99	66,817,559.99
应收利息	—	—	—	343.20	343.20
应收股利	—	—	—	302,560.21	302,560.21

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

应收申购款	2,432.84	—	—	19,929.90	22,362.74
资产总计	2,937,053.34	—	—	67,234,143.30	70,171,196.64
负债					
应付赎回款	—	—	—	365,478.00	365,478.00
应付管理人报酬	—	—	—	99,949.13	99,949.13
应付托管费	—	—	—	19,434.54	19,434.54
其他负债	—	—	—	212,901.74	212,901.74
负债总计	—	—	—	697,763.41	697,763.41
利率敏感度缺口	2,937,053.34	—	—	66,536,379.89	69,473,433.23
上年度末 2011年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,885,065.08	—	—		1,885,065.08
存出保证金	—	—	—	93,750.00	93,750.00
交易性金融资产	—	—	—	51,008,185.30	51,008,185.30
其中:股票投资	—	—	—	51,008,185.30	51,008,185.30
应收利息	—	—	—	261.47	261.47
应收股利	—	—	—	73,849.16	73,849.16
应收申购款	197.47	—	—	13,739.70	13,937.17
资产总计	1,885,262.55	—	—	51,189,785.63	53,075,048.18
负债					
应付证券清算款				75,449.95	75,449.95
应付赎回款				131,116.38	131,116.38
应付管理人报酬				82,948.12	82,948.12
应付托管费				16,128.79	16,128.79
其他负债				60,492.55	60,492.55
负债总计				366,135.79	366,135.79
利率敏感度缺口	1,885,262.55			50,823,649.84	52,708,912.39

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2011年12月31日：同)，因此市场利

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

金额单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日									
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	巴西里尔 折合人民币	南非兰特 折合人民币	韩币 折合人民币	泰铢 折合人民币	墨西哥比索 折合人民币	捷克克朗 折合人民币	印尼盾 折合人民币	合计
以外币计价的资产										
银行存款	2.63	1,474,509.07	—	-	2.65	-	-	-	-	1,474,514.34
交易性金融资产	12,929,587.02	28,260,141.83	1,624,853.66	7,090,791.95	4,338,763.97	5,384,034.45	2,247,902.21	1,862,161.05	3,079,323.85	66,817,559.99
应收股利	164,959.81	13,252.17	4,105.41	—	—	—	—	120,242.87	—	302,560.26
资产合计	**13,094,549.46**	**29,747,903.07**	**1,628,959.07**	**7,090,791.95**	**4,338,766.62**	**5,384,034.45**	**2,247,902.21**	**1,982,403.92**	**3,079,323.85**	**68,594,634.59**
以外币计价的负债										
应付证券清算款	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	**13,094,549.45**	**29,747,903.07**	**1,628,959.07**	**7,090,791.95**	**4,338,766.62**	**5,384,034.45**	**2,247,902.21**	**1,982,403.92**	**3,079,323.85**	**68,594,634.59**

项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日									
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	巴西里尔 折合人民币	南非兰特 折合人民币	韩币 折合人民币	泰铢 折合人民币	墨西哥比索 折合人民币	捷克克朗 折合人民币	印尼盾 折合人民币	合计
以外币计价的资产										
银行存款	2.62	756,899.74	-	-	-	-	-	-	-	756,902.36
交易性金融资产	10,831,503.38	20,631,664.35	1,405,125.34	5,244,563.86	3,685,508.98	4,376,254.18	1,318,367.14	1,575,529.68	1,939,668.39	51,008,185.30
应收股利	-	27,403.23	18,065.15	28,380.78	—	—	—	—	—	73,849.16
资产合计	**10,831,506.00**	**21,415,967.32**	**1,423,190.49**	**5,272,944.64**	**3,685,508.98**	**4,376,254.18**	**1,318,367.14**	**1,575,529.68**	**1,939,668.39**	**51,838,936.82**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

以外币计价的负债										
应付证券清算款	-	75,449.95	-	-	-	-	-	-	-	75,449.95
负债合计	**-**	**75,449.95**	-	-	-	-	-	-	-	**75,449.95**
资产负债表外汇风险敞口净额	**10,831,506.00**	**21,340,517.37**	**1,423,190.49**	**5,272,944.64**	**3,685,508.98**	**4,376,254.18**	**1,318,367.14**	**1,575,529.68**	**1,939,668.39**	**51,763,486.87**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
1. 所有外币相对人民币升值5%		增加约343	增加约259
2. 所有外币相对人民币贬值5%		下降约343	下降约259

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于注册地或者主要经济活动在全球新兴市场国家或者地区的公司或者组织发行的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在对全球宏观经济发展态势，新兴市场国家和地区的经济发展情况、经济运行环境、政策导向以及证券市场运行状况等因素进行研究和判断的基础上，对资产配置、地区配置、行业配置、个股选择以及金融衍生品使用、外汇管理等作出投资决策，以主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的60%-100%，债券和其他资产占基金资产的0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末2012年6月30日		上年度末2011年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	66,817,559.99	96.18	51,008,185.30	96.77
交易性金融资产－基金投资	－	－	－	－

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

衍生金融资产－权证投资	－	－	－	－
其他	－	－	－	－
合计	66,817,559.99	96.18	51,008,185.30	96.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末(2012年6月30日)	上年度末(2011年12月31日)
	1. 业绩比较基准上升5%	增加361	增加约259
	2. 业绩比较基准下降5%	下降361	下降约259

注：本基金的业绩比较基准为摩根士丹利资本国际新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index (Net Total Return))。

6.4.14 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	66,817,559.99	95.22
	其中：普通股	33,173,383.71	47.27
	存托凭证	33,644,176.28	47.95
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
	其中：远期	－	－

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	2,934,620.50	4.18
8	其他各项资产	419,016.15	0.60
9	合计	70,171,196.64	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	12,929,587.02	18.61
美国	12,108,338.09	17.43
英国	8,617,252.79	12.40
南非	7,090,791.95	10.21
卢森堡	5,882,528.48	8.47
泰国	5,384,034.45	7.75
韩国	4,338,763.97	6.25
印度尼西亚	3,079,323.85	4.43
墨西哥	2,247,902.21	3.24
捷克	1,862,161.05	2.68
百慕大	1,652,022.47	2.38
巴西	1,624,853.66	2.34
合计	66,817,559.99	96.18

注：以上国家（地区）均按照股票及存托凭证上市交易地点进行统计。若股票及存托凭证按照发行人注册地或者主要经济活动所属国家（地区）统计，相关国家（地区）投资比例分布如下：中国 18.61%，巴西 12.82%，印度 11.27%，俄罗斯 11.01%，韩国 10.27%，南非 10.2%，泰国 7.75%，印度尼西亚 4.43%，台湾 3.90%，墨西哥 3.24%，捷克 2.68%。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
基础材料	10,191,487.54	14.67
通讯	11,029,552.08	15.88
消费品，周期性	9,815,769.37	14.13
消费品，非周期性	4,095,471.23	5.90
能源	3,115,792.48	4.48
金融	17,530,343.38	25.23
工业	4,359,922.95	6.28
科技	4,817,059.91	6.93
公用事业	1,862,161.05	2.68
合计	66,817,559.99	96.18

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	GAZPROM OAO	俄罗斯天然气	OGZD LI	伦敦证券交易所	英国	52,240.00	3,115,792.48	4.48
2	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	240,000.00	3,091,314.24	4.45
3	TELEKOMUNIKASI TBKL		TLKM IJ	雅加达证券交易所	印度尼西亚	563,500.00	3,079,323.85	4.43
4	KASIKORNBANK	泰国泰华农民银行	KBANK-R TB	泰国证券交易所	泰国	93,200.00	3,024,892.93	4.35
5	PING AN INSURANCE GROUP CO	中国平安	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	59,000.00	2,967,645.36	4.27
6	NASPERS LTD		NPN SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	8,429.00	2,836,091.92	4.08
7	Gerdau Sa	盖尔道集团	GGB US	纽约证券交易所	美国	51,000.00	2,825,712.33	4.07
8	MOBILE TELESYSTEMS		MBT US	纽约证券交易所	美国	25,800.00	2,806,737.63	4.04
9	SAMSUNG ELECTR	韩国三星电子	SMSN LI	伦敦证券交易所	英国	831.00	2,793,559.83	4.02
10	HON HAI PRECISION	鸿海精密	HHPD LI	伦敦证券交易所	英国	70,883.00	2,707,900.48	3.90
11	CHINA CONSTRUCTION BANK	建设银行	939 HK	香港联合交易所	中国香港	621,630.00	2,680,787.93	3.86
12	VALE SA	巴西淡水河谷	VALE/P US	纽约证券交易所	美国	21,600.00	2,665,414.06	3.84
13	PTT GLOBAL CHEMINCAL PCL		PTTGC/F TB	泰国证券交易所	泰国	212,169.00	2,359,141.52	3.40
14	LG CHEM LTD	韩国LG化学有限公司	051910 KS	韩国证券交易所	韩国	1,452.00	2,341,219.63	3.37
15	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	762 HK	香港联合交易所	中国香港	290,000.00	2,307,398.68	3.32
16	GRUPO FINANCIERO BANORTE		GFNORTEO MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	69,000.00	2,247,902.21	3.24

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

17	THE FOSCHINI GROUP LTD	—	TFG SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	22,264.00	2,204,509.97	3.17
18	HERO MOTOCORP LTD	—	B41TT06	卢森堡证券交易所	卢森堡	8,487.00	2,053,774.87	2.96
19	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		TRU SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	29,608.00	2,050,190.06	2.95
20	INFOSYS TECHNOLOGIES	印度印孚瑟斯	INFY US	纳斯达克证券交易所	美国	7,100.00	2,023,500.08	2.91
21	KT&G CORP		033780 KS	韩国证券交易所	韩国	4,455.00	1,997,544.34	2.88
22	BELLE INTERNATIONAL	百丽国际	1880 HK	香港联合交易所	中国香港	176,000.00	1,882,440.81	2.71
23	CEZ AS		CEZ CP	布拉格证券交易所	捷克	8,500.00	1,862,161.05	2.68
24	BANCO BRADESCO	巴西布拉德斯科银行	BBD US	纽约证券交易所	美国	19,000.00	1,786,973.99	2.57
25	SBERBANK	俄罗斯联邦储蓄银行	MERRI00G LX	卢森堡证券交易所	卢森堡	102,877.00	1,730,826.72	2.49
26	CROMPTON GREAVES LTD	印度康格里夫有限公司	CLSA027 BH	百慕大证券交易所	百慕大	119,874.00	1,652,022.47	2.38
27	LOJAS RENNER S.A.		LREN3 BZ	圣保罗证券交易所	巴西	9,200.00	1,624,853.66	2.34
28	Sun Pharmaceutical Industries	印度太阳药业	CITI491 LX	卢森堡证券交易所	卢森堡	22,414.00	1,620,814.13	2.33
29	Sun Pharmaceutical Industries	印度太阳药业	B41KQT7	卢森堡证券交易所	卢森堡	6,645.00	477,112.76	0.69

注：上述表格"所属国家（地区）"均按照股票及存托凭证上市交易地点统计。若股票及存托凭证按照发行人注册地或者主要经济活动所属国家（地区）统计，相关股票及存托凭证所属国家（地区）如下：1、GAZPROM OAO 俄罗斯；2、CHINA RESOURCES LAND LTD 中国；5、PING AN INSURANCE GROUP CO 中国；7、Gerdau Sa 巴西； 8、MOBILE TELESYSTEMS 俄罗斯；9、SAMSUNG ELECTR 韩国；10、HON HAI PRECISION 台湾；11、CHINA CONSTRUCTION BANK 中国；12、VALE SA 巴西；15、CHINA UNICOM HONG KONG LTD 中国；18、HERO MOTOCORP LTD 印度；20、INFOSYS TECHNOLOGIES 印度；24、BANCO BRADESCO 巴西；25、SBERBANK 俄罗斯；26、CROMPTON GREAVES LTD 印度； 28-29、Sun Pharmuceutical Industries 印度。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	3,335,651.14	6.33
2	HERO MOTOCORP LTD	B41TT06	2,085,751.02	3.96
3	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGSGAZPROM OAO	1880 HK	1,913,217.55	3.63
4	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	1,478,082.38	2.80
5	TELEKOMUNIKASI TBK PT	TLKM IJ	1,303,874.86	2.47
6	GAZPROM OAO-SPON ADR	OGZD LI	1,010,499.77	1.92
7	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	999,051.55	1.90
8	VALE SA-SP PREF ADR	VALE/P US	926,495.51	1.76
9	INFOSYS TECHNOLOGIES	INFY US	856,951.20	1.63
10	MOBILE TELESYSTEMS	MBT US	724,120.41	1.37
11	KT&G CORP	033780 KS	722,539.92	1.37
12	CROMPTON GREAVES LTD	CLSA027 BH	697,025.13	1.32
13	CEZ AS	CEZ CP	621,491.90	1.18
14	CHINA CONSTRUCTION BANK	939 HK	591,557.03	1.12
15	NASPERS LTD	NPN SJ	585,071.81	1.11
16	SAMSUNG ELECTR	SMSN LI	583,411.03	1.11
17	LG CHEM LTD	051910 KS	581,830.12	1.10
18	PTT GLOBAL CHEMINCAL PCL	PTTGC/F TB	569,804.36	1.08
19	PING AN INSURANCE GROUP CO	2318 HK	512,976.87	0.97
20	BANCO BRADESCO	BBD US	512,619.68	0.97

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 HK	2,842,599.99	5.39
2	CHINA SHENHUA ENERGY CO	2319 HK	2,216,263.43	4.20
3	CHANGSHA ZOOMLION HEAVY IN	1157 HK	1,950,177.23	3.70
4	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	682,366.07	1.29
5	TELEKOMUNIKASI TBK PT	TLKM IJ	528,506.75	1.00
6	GRUPO FINANCIERO BANORTE	GFNORTEO MM	471,607.42	0.89
7	SAMSUNG ELECTR	SMSN LI	435,363.31	0.83
8	KASIKORNBANK PCL	KBANK-R TB	401,450.68	0.76
9	NASPERS LTD	NPN SJ	399,424.02	0.76
10	KT&G CORP	033780 KS	368,044.38	0.70
11	MOBILE TELESYSTEMS	MBT US	363,307.66	0.69
12	HON HAI PRECISION	HHPD LI	198,772.46	0.38
13	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	TRU SJ	197,364.22	0.37
14	Sun Pharmuceutical Industries	CITI491 LX	132,788.19	0.25

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	24,146,633.00
卖出收入（成交）总额	11,188,035.69

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3 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	93,750.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	302,560.21
4	应收利息	343.20
5	应收申购款	22,362.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	419,016.15

7.11.4 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债券投资。

7.11.5 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中不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§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

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
2,944	26,073.75	11,905,301.67	15.51%	64,855,820.16	84.49%

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

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	包淑萍	210,062.00	9.08%
2	何驰峰	200,000.00	8.65%
3	夏克金	160,600.00	6.94%
4	刘玉彬	107,699.00	4.66%
5	骆家华	103,099.00	4.46%
6	黄芳	94,900.00	4.10%
7	陆幼忻	61,579.00	2.66%
8	秦竞	60,001.00	2.59%
9	朱允之	57,511.00	2.49%
10	朱三达	56,245.00	2.43%

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	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	130,493.88	0.17%

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份额总量的数量区间为0。
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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

单位：份

基金合同生效日(2010年6月10日)基金份额总额	443,165,098.58
本报告期期初基金份额总额	63,269,932.13
本报告期基金总申购份额	39,982,184.97
减：本报告期基金总赎回份额	26,490,995.27
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	76,761,121.83

§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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

10.7 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	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	
CLSA SECURITIES	5,938,641.15	16.81%	2,659.60	5.09%	
NOMURA SECURITIES LONDON	5,497,729.25	15.56%	10,995.46	21.03%	
JP MORGAN	4,792,299.79	13.56%	2,668.17	5.10%	
CS FIRST BOSTON	3,953,975.59	11.19%	18,624.92	35.62%	
GOLDMAN SACHS	3,692,212.02	10.45%	5,584.60	10.68%	
UBS INVESTMENT BANK	2,928,753.37	8.29%	1,596.20	3.05%	
MERRILL LYNCH	2,515,535.30	7.11%	1,336.89	2.56%	
MORGAN STANLEY	1,898,079.76	5.37%	2,172.96	4.16%	
DAIWA SECURITIES SMBC EUROPE	974,490.10	2.76%	1,948.98	3.73%	
DEUTSCHE BANK AG	869,622.92	2.46%	860.26	1.65%	
MACQUARIE EQUITIES LIMITED	776,259.25	2.20%	1,552.53	2.97%	
MACQUARIE BANK LIMITED	372,064.35	1.05%	558.12	1.07%	
CITIBANK	298,046.95	0.84%	132.21	0.25%	
CREDITANSTALT BRATISLAVA	263,922.99	0.75%	791.77	1.51%	
UBS ASIA SECURITIES ASIA LTD	228,955.32	0.65%	137.39	0.26%	
PARIBAS	224,001.30	0.63%	448.01	0.86%	
China Int Capital Corp HK SEC	110,109.28	0.31%	220.22	0.42%	

注：1、在选择券商上符合中国证监会的有关规定，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券商选择的选择标准，进行考评后提出券商选择及更换方案，经批准后执行。

2、本基金本报告期未发生交易所债券、回购及权证交易。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	基金经理变更公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2012-03-10
2	关于暂停及恢复申购（含定期定额投资）和赎回业务的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2012-04-05

§11　备查文件目录

11.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2009]1375号）

《关于国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）备案确认的函》（证监基金[2010]363号）

《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》

《国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金（LOF）2012年半年度报告原文

11.2 存放地点

深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址：http://www.ubssdic.com

11.3 查阅方式

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：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一二年八月二十七日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站