

**国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015年半年度报告**

**2015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：2015年8月28日**

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015年8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、财务会计报告和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2015年1月1日起至6月30日止。

## 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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 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、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45

---

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4	基金投资策略的改变 .....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8	其他重大事件 .....	47
§11	备查文件目录 .....	47
11.1	备查文件目录 .....	47
11.2	存放地点 .....	48
11.3	查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	国投金融地产ETF联接
基金主代码	161211
交易代码	161211/161212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月9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	1,031,686,361.18份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：金地ETF）
基金主代码	159933
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年9月17日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年10月16日
基金管理人名称	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主要投资于目标ETF基金份额，力争实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
投资策略	1、资产配置策略 本基金为目标ETF的联接基金，投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认

	<p>的目标ETF份额可计入在内)；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金可以通过一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的投资，本基金将根据开放日申购赎回情况，综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标ETF的投资方式。此外，本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，以提高投资组合的运作效率。本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。</p>
业绩比较基准	95%×沪深300金融地产指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合，并根据标的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>当预期标的指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为，或因基金的申购与赎回以及其他特殊情况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> <p>在正常市场情况下，本基金力求将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人将采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，以提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	沪深300 金融地产指数
风险收益特征	<p>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。本基金被动跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

注：

### 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	刘凯
	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
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	叶柏寿	姜建清

## 2.4 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	<a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a>
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

## 2.5 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	北京西城区金融大街27号投资广场 23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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	478,097,623.02
本期利润	134,220,506.82
加权平均基金份额本期利润	0.0844
本期加权平均净值利润率	5.73%
本期基金份额净值增长率	3.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)

期末可供分配利润	200,442,957.89
期末可供分配基金份额利润	0.1943
期末基金资产净值	1,550,542,090.39
期末基金份额净值	1.5029
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	50.29%

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

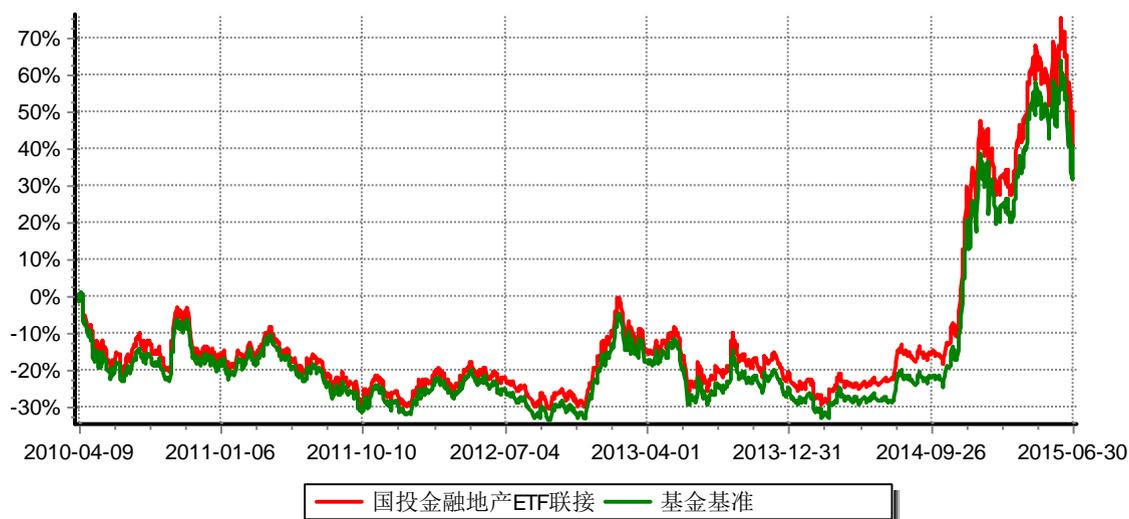
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-3.19%	3.33%	-3.40%	3.29%	0.21%	0.04%
过去三个月	2.27%	2.62%	1.55%	2.58%	0.72%	0.04%
过去六个月	3.37%	2.46%	3.13%	2.44%	0.24%	0.02%
过去一年	95.74%	2.20%	95.55%	2.20%	0.19%	0.00%
过去三年	92.93%	1.76%	88.17%	1.76%	4.76%	0.00%
自基金合同生效日起至今	50.29%	1.63%	40.71%	1.63%	9.58%	0.00%

注：1、本基金是以国投瑞银沪深300金融地产交易型指数基金为目标的联接基金，对目标ETF的配置不低于基金资产净值90%，故以 $95\% \times \text{沪深300金融地产指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率}$ （税后）作为本基金业绩比较基准。

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：2013年11月5日起国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）转型变更为国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金（简称“本基金”）。《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2013年11月5日起生效。本基金建仓期为自基金合同生效日起的3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。

## § 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，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）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。截止2015年6月底，在公募基金方面，公司共管理44只基金，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自2008年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自2006年开始为QFII和信托计划提供投资咨询服务，具有丰富经验，并于2007年获得QDII资格。

#### 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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
赵建	本基金基金经理	2015年2月10日	—	12	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于上海博弘投资有限公司、上海数君投资有限公司、上海一维科技有限公司。2010年6月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞福深证100指数分级基金、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数基金（LOF）、国投瑞银金融地产交易型开放式指数基金联接基金和国投瑞银创业指数分级基金基金经理。

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《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（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。

##### 4.3.2 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

上半年,我国宏观经济下行压力较大,投资持续回落仍然是拖累经济的最主要因素。政府基建和房地产投资都处于增速下台阶中,虽然部分城市房价略有回升,但地产周期大拐点较为明确,同时传导到投资也有时滞,此外制造业去产能的过程尚未结束。这些因素共同导致上半年投资增速较去年同期明显回落。

此外,由于美元走强,人民币对主要国家货币升值,上半年出口增速低位徘徊。受制于收入放缓,消费增速再下台阶。实体经济有效贷款需求不足,M2维持低位。在此背景下,一季度经济加速下行,二季度虽然显示出一定企稳迹象,但其基础仍不牢固。

本基金遵循ETF联接基金的被动投资原则,力求实现对业绩比较基准的紧密跟踪。操作上力保基金的平稳运作,做好基金的日常风险管控工作。同时在组合投资管理上严格控制跟踪误差,研究应对成分股调整等机会成本、同时也密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及相应市场出现的结构性机会。

##### 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1.5029元,本报告期份额净值增长率为3.37%,同期业绩比较基准收益率为3.13%,基金净值增长率高于业绩基准收益率0.24%,主要受报告期内指数成分股调整、基金的申购赎回活动、部分利息股息收入及扣减费率等综合因素的影响。报告期内,日跟踪偏离度绝对值的平均值为0.05%,年化跟踪误差为1.69%,符合基金合同约定的日跟踪偏离度绝对值的平均值不超过0.35%以及年化跟踪误差不超过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

展望下半年,经济预计依然呈下行走势,货币政策引导利率进一步下行,大类资产配置中仍然有利于股权投资,在相对有利的宏观和流动性环境下,权益类指数型基金的表现值得关注。

#### 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**

本基金本期已实现收益为478,097,623.02元，期末可供分配利润为200,442,957.89元。本报告期本基金未进行收益分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§ 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**

本报告期内，本基金托管人在对国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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**

本报告期内，国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人--国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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。

#### **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沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015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：国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	95,158,737.99	189,331,577.89
结算备付金		—	1,731,426.99
存出保证金		771,568.40	292,591.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,451,392,318.87	2,273,918,693.37
其中：股票投资		123,727,548.99	91,179,539.09
基金投资		1,327,664,769.88	2,182,739,154.28
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
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	18,296.33	71,259.72
应收股利		—	—
应收申购款		106,086,020.40	166,748,531.18
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	557,651.83
资产总计		1,653,426,941.99	2,632,651,732.66

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>负 债：</b>			
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		65,554,505.72	72,938,913.15
应付赎回款		35,601,568.42	147,533,526.93
应付管理人报酬		66,991.23	90,525.00
应付托管费		14,514.76	19,613.72
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	1,131,890.41	1,251,254.35
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	515,381.06	830,922.74
负债合计		102,884,851.60	222,664,755.89
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,031,686,361.18	1,657,548,706.38
未分配利润	6.4.7.10	518,855,729.21	752,438,270.39
所有者权益合计		1,550,542,090.39	2,409,986,976.77
负债和所有者权益总计		1,653,426,941.99	2,632,651,732.66

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.5029元，基金份额总额1,031,686,361.18份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2015年1月1日	上年度可比期间
-----	-----	-------------	---------

		至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
<b>一、收入</b>		139,099,037.13	-48,570,482.83
1.利息收入		568,684.47	239,180.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	568,684.47	239,180.28
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		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		477,399,497.98	-12,986,621.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,165,339.05	-1,194,583.37
基金投资收益		467,783,170.37	-11,907,460.41
债券投资收益		—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
股利收益	6.4.7.14	450,988.56	115,421.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-343,877,116.20	-36,097,593.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,007,970.88	274,552.48
<b>减：二、费用</b>		4,878,530.31	1,032,431.10
1. 管理人报酬		616,037.27	259,619.85
2. 托管费		133,474.69	56,250.95
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.17	3,942,688.76	488,105.93

5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.18	186,329.59	228,454.37
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		134,220,506.82	-49,602,913.93
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		134,220,506.82	-49,602,913.93

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	1,657,548,706.38	752,438,270.39	2,409,986,976.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	134,220,506.82	134,220,506.82
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)	-625,862,345.20	-367,803,048.00	-993,665,393.20
其中：1.基金申购款	2,339,575,775.22	1,030,978,347.80	3,370,554,123.02
2.基金赎回款	-2,965,438,120.42	-1,398,781,395.80	-4,364,219,516.22
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)	1,031,686,361.18	518,855,729.21	1,550,542,090.39
项目	上年度可比期间		

	2014年1月1日至2014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)	1,562,682,318.16	-319,087,670.10	1,243,594,648.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-49,602,913.93	-49,602,913.93
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)	-75,458,149.15	23,368,991.95	-52,089,157.20
其中：1.基金申购款	282,413,077.64	-63,827,493.73	218,585,583.91
2.基金赎回款	-357,871,226.79	87,196,485.68	-270,674,741.11
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)	1,487,224,169.01	-345,321,592.08	1,141,902,576.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘纯亮

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"本基金")是由国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金(LOF)(以下简称"原基金")通过基金合同修订变更而来。原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[2010]第69号《关于核准国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金(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《国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。原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1,722,936,524.64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077号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国投瑞银沪深300金融地产指数

证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年4月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,723,171,301.29份基金份额，其中认购资金利息折合234,776.65份基金份额。原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。

原基金基金份额持有人大会自2013年9月9日起至2013年10月18日止以通讯方式召开，会议审议通过了《关于国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金(LOF)变更为国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》，经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议，《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》自2013年11月5日生效，基金投资目标、范围和策略调整，同时“国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金(LOF)”更名为“国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第181号文审核同意，原基金496,448,878.00份基金份额于2010年6月8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。本基金基金合同生效后，原基金场内份额转换为国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，原基金的投资范围为沪深300金融地产指数成份股及其备选成份股、新股、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。原基金投资于沪深300金融地产指数成份股票及其备选成份股票的投资比例不低于基金资产净值的90%；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%；权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；原基金对沪深300金融地产指数成份股的配置基准为95%。原基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。原基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深300 金融地产指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

本基金是目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对沪深300金融地产指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离交易可转债存债、次级债、短期融资券、中期票

据、资产支持证券、地方政府债等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内);本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300金融地产指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

#### 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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会及中国证券投资基金业协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2015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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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。

##### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关

于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期自2015年3月30日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### **6.4.5.3 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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 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 2015年6月30日
活期存款	95,158,737.99
定期存款	—
其中:存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	95,158,737.99

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	119,402,822.40	123,727,548.99	4,324,726.59
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	—	—	—
交易所市场	—	—	—

	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		992,588,500.29	1,327,664,769.88	335,076,269.59
其他		—	—	—
合计		1,111,991,322.69	1,451,392,318.87	339,400,996.18

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	17,834.21
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	149.64
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	312.48
合计	18,296.33

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,131,890.41
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,131,890.41

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	129,423.47
审计费用	37,191.88
信息披露费	200,000.00
预提信息披露费	148,765.71
合计	515,381.06

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,657,548,706.38	1,657,548,706.38
本期申购	2,339,575,775.22	2,339,575,775.22
本期赎回（以“-”号填列）	-2,965,438,120.42	-2,965,438,120.42
本期末	1,031,686,361.18	1,031,686,361.18

#### 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	-244,738,036.19	997,176,306.58	752,438,270.39
本期利润	478,097,623.02	-343,877,116.20	134,220,506.82
本期基金份额交易产	-32,916,628.94	-334,886,419.06	-367,803,048.00

生的变动数			
其中：基金申购款	-215,149,941.11	1,246,128,288.91	1,030,978,347.80
基金赎回款	182,233,312.17	-1,581,014,707.97	-1,398,781,395.80
本期已分配利润	—	—	—
本期末	200,442,957.89	318,412,771.32	518,855,729.21

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	536,986.51
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	26,107.96
其他	5,590.00
合计	568,684.47

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	3,193,037.29
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	9,165,339.05

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,580,507,933.00
减：卖出股票成本总额	1,577,314,895.71
买卖股票差价收入	3,193,037.29

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
申购基金份额总额	779,950,300.00
减：现金支付申购款总额	18,864,264.49
减：申购股票成本总额	755,113,733.75
申购差价收入	5,972,301.76

### 6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,759,315,266.99
减：卖出/赎回基金成本总额	1,291,532,096.62
基金投资收益	467,783,170.37

### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	450,988.56
基金投资产生的股利收益	—
合计	450,988.56

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

1.交易性金融资产	-343,877,116.20
——股票投资	1,042,689.17
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	-344919805.37
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-343,877,116.20

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	5,007,970.88
合计	5,007,970.88

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。

#### 6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	3,942,688.76
银行间市场交易费用	—
合计	3,942,688.76

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	148,765.71
资金汇划费	372.00
上市费	—
指数使用费	—
持有人大会费用	—
其他费用	—
合计	186,329.59

#### 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，本基金并无须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2015年上半年度，并无与本基金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。

##### 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
国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金("目标ETF")	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

#### 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

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。

### 6.4.10.2 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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	616,037.27	259,619.85
其中：支付销售机构的客户维护费	2,194,332.00	620,861.63

注：原基金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0.60%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 × 0.60% / 当年天数。

本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。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扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取0)的0.6%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扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取0) × 0.6% ÷ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	133,474.69	56,250.95

注：原基金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0.13%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 × 0.13% / 当年天数。

本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。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扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取

0)的0.13%的年费率计提。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额(若为负数，则取0) ×0.13% ÷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的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

本基金本期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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

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。

### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6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	95,158,737.99	536,986.51	59,115,946.89	226,362.36

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。

### 6.4.10.6 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

于2015年6月30日，本基金持有720,656,120.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为95.85% (2014年12月31日，本基金持有1,225,500,620.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为94.17%)。

### 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（2015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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
300487	蓝晓科技	2015-06-24	2015-07-02	新股锁定	14.83	14.83	500	7,415	7,415

### 6.4.12.2 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
000024	招商地产	2015-04-03	重大资产重组停牌	36.43		—	23,565	694,837.96	858,472.95

注：本基金截至2015年6月30日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。

### 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

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 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

本基金为交易型开放式指数证券投资基金联接基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离交易可转债存债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这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。本基金通过投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股，力求获得标的指数所代表行业平均收益

率以使投资者分享中国经济与金融地产行业发展的中长期收益。

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。

本基金的基金管理人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 中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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2015年6月30日，本基金未持有债券（2014年12月31日：同）。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券在证券交易所上市，金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2015年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

本基金持有及承担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和结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	95,158,737.99				95,158,737.99
存出保证金	771,568.40				771,568.40
交易性金融资产	—			1,451,392,318.87	1,451,392,318.87
应收利息	—			18,296.33	18,296.33
应收申购款	100,163,143			5,922,876.7	106,086,020

	.62			8	.40
资产总计	196,093,450.01	—	—	1,457,333,491.98	1,653,426,941.99
负债					
应付证券清算款	—			65,554,505.72	65,554,505.72
应付赎回款	—			35,601,568.42	35,601,568.42
应付管理人报酬	—			66,991.23	66,991.23
应付托管费	—			14,514.76	14,514.76
应付交易费用	—			1,131,890.41	1,131,890.41
其他负债	—			515,381.06	515,381.06
负债总计	—	—	—	102,884,851.60	102,884,851.60
利率敏感度缺口	196,093,450.01	—	—	1,354,448,640.38	1,550,542,090.39
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	189,331,577.89	—	—	—	189,331,577.89
结算备付金	1,731,426.99	—	—	—	1,731,426.99
存出保证金	292,591.68	—	—	—	292,591.68
交易性金融资产	—	—	—	2,273,918,693.37	2,273,918,693.37
应收利息	—	—	—	71,259.72	71,259.72
其他资产	—	—	—	557,651.83	557,651.83
应收申购款	111,723,387.13	—	—	55,025,144.05	166,748,531.18
资产总计	303,078,983	—	—	2,329,572,7	2,632,651,7

	.69			48.97	32.66
负债					
应付证券清算款	—	—	—	72,938,913.15	72,938,913.15
应付赎回款	—	—	—	147,533,526.93	147,533,526.93
应付管理人报酬	—	—	—	90,525.00	90,525.00
应付托管费	—	—	—	19,613.72	19,613.72
应付交易费用	—	—	—	1,251,254.35	1,251,254.35
其他负债	—	—	—	830,922.74	830,922.74
负债总计	—	—	—	222,664,755.89	222,664,755.89
利率敏感度缺口	303,078,983.69	—	—	2,106,907,993.08	2,409,986,976.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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2015年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2014年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。本基金为目标ETF的联接基金，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内); 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券; 权证投资占基金资产净值的比例为0-3%; 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 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31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	123,727,548.99	7.98	91,179,539.09	3.78
交易性金融资产-基金投资	1,327,664,769.88	85.63	2,182,739,154.28	90.57
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,451,392,318.87	93.61	2,273,918,693.37	94.35

#### 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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	上升约7,791	上升约11,915
	2. 业绩比较基准下降5%	下降约7,791	下降约11,915

注: 本基金的业绩比较基准为:  $95\% \times$  沪深300 金融地产指数收益率  $+ 5\% \times$  银行活期存款利率(税后)。

#### 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(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	123,727,548.99	7.48
	其中：股票	123,727,548.99	7.48
2	基金投资	1,327,664,769.88	80.30
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	95,158,737.99	5.76
8	其他资产	106,875,885.13	6.46
9	合计	1,653,426,941.99	100.00

### 7.2 报告期末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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	65,725.00	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—

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	—	—
J	金融业	111,398,264.49	7.18
K	房地产业	12,243,269.50	0.79
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	20,290.00	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	123,727,548.99	7.98

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	151,895	12,446,276.30	0.80
2	600036	招商银行	460,738	8,625,015.36	0.56
3	600016	民生银行	764,636	7,600,481.84	0.49
4	600000	浦发银行	395,611	6,709,562.56	0.43
5	600030	中信证券	221,081	5,949,289.71	0.38
6	601166	兴业银行	315,920	5,449,620.00	0.35
7	600837	海通证券	227,055	4,949,799.00	0.32
8	601328	交通银行	541,811	4,464,522.64	0.29
9	000002	万科A	268,826	3,903,353.52	0.25
10	601398	工商银行	671,824	3,547,230.72	0.23
11	601988	中国银行	648,023	3,168,832.47	0.20
12	601169	北京银行	234,132	3,118,638.24	0.20

13	601818	光大银行	557,986	2,990,804.96	0.19
14	601601	中国太保	91,073	2,748,583.14	0.18
15	601288	农业银行	740,092	2,745,741.32	0.18
16	600109	国金证券	109,150	2,663,260.00	0.17
17	000001	平安银行	180,341	2,622,158.14	0.17
18	000783	长江证券	151,366	2,111,555.70	0.14
19	601688	华泰证券	91,052	2,106,032.76	0.14
20	600048	保利地产	183,231	2,092,498.02	0.13
21	000166	申万宏源	125,877	2,045,501.25	0.13
22	600015	华夏银行	124,377	1,891,774.17	0.12
23	000776	广发证券	82,677	1,872,634.05	0.12
24	600999	招商证券	65,011	1,720,191.06	0.11
25	601628	中国人寿	52,006	1,628,827.92	0.11
26	601377	兴业证券	117,087	1,602,921.03	0.10
27	601336	新华保险	26,069	1,591,773.14	0.10
28	600705	中航资本	65,061	1,506,162.15	0.10
29	601901	方正证券	117,039	1,391,593.71	0.09
30	000728	国元证券	34,846	1,323,451.08	0.09
31	600383	金地集团	100,673	1,273,513.45	0.08
32	601009	南京银行	54,332	1,238,769.60	0.08
33	601788	光大证券	39,025	1,051,723.75	0.07
34	601555	东吴证券	45,896	939,491.12	0.06
35	000402	金融街	65,129	920,272.77	0.06
36	000024	招商地产	23,565	858,472.95	0.06
37	601099	太平洋	65,000	839,800.00	0.05
38	002142	宁波银行	39,044	825,780.60	0.05
39	600663	陆家嘴	16,085	800,067.90	0.05
40	600340	华夏幸福	26,053	793,313.85	0.05
41	600369	西南证券	39,093	768,177.45	0.05
42	601939	建设银行	105,780	754,211.40	0.05
43	002673	西部证券	26,012	737,960.44	0.05

44	002500	山西证券	39,022	705,907.98	0.05
45	601998	中信银行	91,055	702,034.05	0.05
46	000686	东北证券	34,864	678,802.08	0.04
47	000750	国海证券	39,087	656,661.60	0.04
48	000046	泛海控股	39,000	571,350.00	0.04
49	600208	新潮中宝	70,282	542,577.04	0.03
50	002146	荣盛发展	39,028	487,850.00	0.03
51	002736	国信证券	15,000	376,350.00	0.02
52	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.02
53	000712	锦龙股份	5,000	175,500.00	0.01
54	600958	东方证券	4,000	114,480.00	0.01
55	603116	红蜻蜓	1,000	28,040.00	—
56	603589	口子窖	1,000	25,340.00	—
57	002776	柏堡龙	500	20,290.00	—
58	300487	蓝晓科技	500	7,415.00	—
59	002770	N科迪	500	4,930.00	—

## 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	601318	中国平安	69,186,948.25	2.87
2	600036	招商银行	49,106,047.30	2.04
3	600030	中信证券	47,843,072.57	1.99
4	600016	民生银行	45,520,117.24	1.89
5	601166	兴业银行	34,748,574.00	1.44
6	600837	海通证券	34,518,600.86	1.43
7	600000	浦发银行	32,535,846.57	1.35
8	000002	万科A	24,900,883.52	1.03
9	601328	交通银行	20,177,201.00	0.84

10	601601	XD中国太	19,119,221.70	0.79
11	601288	农业银行	18,042,484.00	0.75
12	601818	光大银行	17,435,652.00	0.72
13	601398	工商银行	16,588,364.06	0.69
14	000001	平安银行	16,130,570.89	0.67
15	000776	广发证券	13,686,509.50	0.57
16	601688	华泰证券	13,614,141.88	0.56
17	601169	DR北京银	13,453,545.24	0.56
18	600999	招商证券	12,413,773.34	0.52
19	600048	保利地产	12,296,470.80	0.51
20	600015	华夏银行	10,903,169.00	0.45

注：1、买入包括基金二级市场上主动地买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，不包括因本基金赎回标的ETF基金份额导致的基金组合中股票的增加；

2、“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	601318	中国平安	168,461,874.76	6.99
2	600036	招商银行	110,008,372.77	4.56
3	600016	民生银行	107,794,212.45	4.47
4	600030	中信证券	98,765,420.80	4.10
5	601166	兴业银行	81,367,200.76	3.38
6	600837	海通证券	80,034,390.71	3.32
7	600000	浦发银行	72,378,122.48	3.00
8	000002	万 科 A	51,847,833.72	2.15
9	601328	交通银行	42,712,036.73	1.77
10	601601	XD中国太	41,317,651.95	1.71
11	601818	光大银行	38,788,923.17	1.61
12	601288	农业银行	38,706,395.46	1.61
13	000001	平安银行	38,300,520.99	1.59

14	601398	工商银行	37,410,602.27	1.55
15	601988	中国银行	36,003,227.43	1.49
16	601169	DR北京银	31,606,108.78	1.31
17	601688	华泰证券	30,502,850.74	1.27
18	600048	保利地产	30,459,669.24	1.26
19	000776	广发证券	30,080,296.64	1.25
20	600999	招商证券	27,915,910.74	1.16

注：1、卖出主要指二级市场上主动地卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，不包括因本基金申购标的ETF基金份额导致的基金组合中股票的减少；

2、“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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	682,097,310.19
卖出股票的收入（成交）总额	1,580,507,933.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动地买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动地卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，不包括因本基金申购赎回标的ETF基金份额导致的基金组合中股票的增减；

2、“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

本基金本报告期末未持有债券资产。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券资产。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

### 7.10 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	金地ETF	股票型	交易型 开放式	国投瑞银 基金管理 有限公司	1,327,664,769.88	85.63

### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.12.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

### 7.13.3 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	771,568.40
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	18,296.33
5	应收申购款	106,086,020.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	106,875,885.13

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券资产。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### 7.13.6 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

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
29,966	34,428.56	579,960,700.48	56.21%	451,725,660.70	43.79%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,701,581.33	0.46%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年4月9日)基金份额总额	1,723,171,301.29
本报告期期初基金份额总额	1,657,548,706.38
本报告期基金总申购份额	2,339,575,775.22
减：本报告期基金总赎回份额	2,965,438,120.42
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,031,686,361.18

## § 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等情况

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 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	617,064,129.86	27.28%	561,774.91	27.28%	—
长江证券	1	386,704,718.72	17.09%	352,055.14	17.09%	—
东方证券	1	329,708,581.99	14.57%	300,167	14.57%	—
长城证券	1	245,558,698.24	10.85%	223,556.44	10.85%	—
瑞银证券	1	196,004,353.21	8.66%	178,442.35	8.66%	—
中信证券	2	165,141,449.17	7.3%	150,344.63	7.3%	—
齐鲁证券	1	121,727,127.85	5.38%	110,820.53	5.38%	—
民生证券	1	110,471,481.29	4.88%	100,572.94	4.88%	—
平安证券	1	75,286,750.54	3.33%	68,541.06	3.33%	—
安信证券	1	14,635,0	0.65%	13,323.83	0.65%	—

		52.32				
国信证券	1	—	—	—	—	—

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

- 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、本报告期本基金未发生交易所债券、交易所回购及权证交易。
- 3、本基金本报告期租用交易单元未发生变更。

## 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	关于本基金基金经理变更公告	《证券时报》	2015-02-10
2	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2015-03-31
3	关于本基金持有的招商银行进行估值调整的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2015-04-08
4	关于网上直销转账汇款买基金减免认、申购费的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2015-06-01
5	关于本基金持有的城投控股进行估值调整的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2015-06-02
6	关于本基金持有的招商地产进行估值调整的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》	2015-06-12

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

《关于国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议

备案的回函》（基金部函[2013]910号）

《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

《关于核准国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2010]69号）

《关于国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）备案确认的函》（证监基金[2010]175号）

《国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》

《国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（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

国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015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

二〇一五年八月二十八日