

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金
2016 年半年度报告摘要
2016 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

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

1 重要提示

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 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|---------------------|---------------------|--------------------------|--------------------------|
| 基金简称 | 国投瑞银沪深 300 指数分级 | | |
| 基金主代码 | 161207 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 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 | 119,665,590.01 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 | 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 | 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 |
| 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 | 70,074,606.01 份 | 24,795,492.00 份 | 24,795,492.00 份 |

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。 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。 |
| 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 | 中国工商银行股份有限公 |

| | | | |
|-------------|------|---------------------|---------------------|
| | | 司 | 司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 刘凯 | 洪渊 |
| | 联系电话 | 400-880-6868 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@ubssdic.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-880-6868 | 95588 |
| 传真 | | 0755-82904048 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告摘要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

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -3,176,729.94 |
| 本期利润 | -18,263,437.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1498 |
| 本期基金份额净值增长率 | -13.42% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0540 |
| 期末基金资产净值 | 113,432,272.70 |
| 期末基金份额净值 | 0.948 |

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 | 0.64% | 0.97% | -0.46% | 0.93% | 1.10% | 0.04% |
| 过去三个月 | 0.11% | 1.02% | -1.87% | 0.96% | 1.98% | 0.06% |
| 过去六个月 | -13.42% | 1.88% | -14.65% | 1.75% | 1.23% | 0.13% |
| 过去一年 | -26.15% | 2.93% | -27.99% | 2.19% | 1.84% | 0.74% |
| 过去三年 | 47.65% | 2.10% | 41.77% | 1.75% | 5.88% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.25% | 1.85% | -0.05% | 1.54% | -2.20% | 0.31% |

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

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2009 年 10 月 14 日至 2016 年 6 月 30 日）



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

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、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止 2016 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 59 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）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 殷瑞飞 | 本基金基金经理 | 2013-09-26 | - | 9 | 中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于汇添富基金管理公司。2011 年 6 月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金、国投瑞银金融地产交易型开放式指数证券投资基金、国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金（LOF）、国投瑞银新收益灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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，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，形成了有效的公平交易体系。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

2016 年上半年，在经历了持续的货币宽松和各个地方对房地产的支持的政策之后，房地产销售回暖、新开工由负转正，宏观经济有企稳态势；供给侧改革稳步推进，在煤炭、钢铁等行业取得一定成效。国际市场，英国公投脱欧，全球金融市场增加了不确定性。

1 月份全球金融市场震荡，A 股也难以幸免，2、3 月份市场逐步企稳。1 月份的下跌缘于市场本身高估值对于全球流动性收缩等利空因素的敏感反应，同时风险也得到较大的释放。2 月份到 6 月份，指数基本上呈现震荡走势，结构性机会此起彼伏，新能源、禽类、有色、白酒等行业表现较好。

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，研究应对成分股调整、成分股停牌替代等机会成本、同时密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及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 0.948 元，本报告期份额净值增长率为-13.42%，同期业绩比较基准收益率为-14.65%，基金净值增长率高于业绩基准收益率，主要受报告期内停牌股票估值调整、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。

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，考虑稳增长的滞后效果，预计下半年经济增速与上半年大致持平或略有改善，而 PPI 同比增速的一路上行会给予企业盈利同比增速一定支持，有助于部

分行业企业盈利预期的改善。下半年“资产荒”环境未变，股债两个市场再融资规模的收缩，使得可投资的风险资产进一步减少，大类资产配置中仍然有利于股权投资，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

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

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

的义务。

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

本报告期内，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 2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 10,563,035.88 | 7,047,997.32 |
| 结算备付金 | 153,102.54 | 143,594.79 |
| 存出保证金 | 6,722.38 | 20,862.84 |
| 交易性金融资产 | 103,148,917.68 | 126,375,218.68 |
| 其中：股票投资 | 103,148,917.68 | 126,375,218.68 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 1,733,650.30 |

| | | |
|-------------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 应收利息 | 1,945.03 | 1,810.79 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 4,288.24 | 3,979.20 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 113,878,011.75 | 135,327,113.92 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 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 | 2,778.56 | 34,781.30 |
| 应付管理人报酬 | 91,990.19 | 116,085.65 |
| 应付托管费 | 20,237.85 | 25,538.85 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 51,708.59 | 90,274.37 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 279,023.86 | 260,067.22 |
| 负债合计 | 445,739.05 | 526,747.39 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 119,890,266.89 | 123,198,406.89 |
| 未分配利润 | -6,457,994.19 | 11,601,959.64 |
| 所有者权益合计 | 113,432,272.70 | 134,800,366.53 |
| 负债和所有者权益总计 | 113,878,011.75 | 135,327,113.92 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，国投瑞银瑞和沪深 300 指数份额净值 0.948 元，国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数份额净值 0.948 元，国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数份额净值 0.948 元；基金份额总额 119,665,590.01 份，其中国投瑞银瑞和沪深 300 指数份额 70,074,606.01 份，国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数份额 24,795,492.00 份，国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数份额 24,795,492.00 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|--|---|
| 一、收入 | -17,225,737.36 | 61,196,100.16 |
| 1.利息收入 | 42,598.97 | 51,161.11 |
| 其中：存款利息收入 | 42,597.75 | 51,161.11 |
| 债券利息收入 | 1.22 | - |
| 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） | -2,190,813.35 | 101,443,760.98 |
| 其中：股票投资收益 | -3,168,277.34 | 100,015,003.50 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,358.88 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 975,105.11 | 1,428,757.48 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -15,086,707.35 | -40,633,069.17 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 9,184.37 | 334,247.24 |
| 减：二、费用 | 1,037,699.93 | 2,679,456.21 |
| 1. 管理人报酬 | 560,034.80 | 1,274,623.10 |
| 2. 托管费 | 123,207.70 | 280,417.07 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 157,091.05 | 940,973.55 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 197,366.38 | 183,442.49 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -18,263,437.29 | 58,516,643.95 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -18,263,437.29 | 58,516,643.95 |

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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) | 123,198,406.89 | 11,601,959.64 | 134,800,366.53 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | -18,263,437.29 | -18,263,437.29 |
| 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) | -3,308,140.00 | 203,483.46 | -3,104,656.54 |
| 其中: 1.基金申购款 | 8,562,206.27 | -260,821.77 | 8,301,384.50 |
| 2.基金赎回款 | -11,870,346.27 | 464,305.23 | -11,406,041.04 |
| 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) | 119,890,266.89 | -6,457,994.19 | 113,432,272.70 |
| 项目 | 上年度可比期间 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) | 396,507,329.22 | 20,233,500.70 | 416,740,829.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | 58,516,643.95 | 58,516,643.95 |
| 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) | -250,848,081.04 | -36,760,755.49 | -287,608,836.53 |
| 其中: 1.基金申购款 | 127,698,467.06 | 6,500,092.35 | 134,198,559.41 |
| 2.基金赎回款 | -378,546,548.10 | -43,260,847.84 | -421,807,395.94 |
| 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) | 145,659,248.18 | 41,989,389.16 | 187,648,637.34 |

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：

基金管理人负责人：王彬，主管会计工作负责人：王彬，会计机构负责人：冯伟

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》、《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局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》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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 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

本报告期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。

6.4.7.2 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 |

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。

6.4.8 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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 2016年1月1日至2016年 6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 560,034.80 | 1,274,623.10 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 62,222.48 | 130,387.29 |

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年 6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 123,207.70 | 280,417.07 |

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|---------|----------------------------|-----------------|-----------------|---------------------------------|-----------------|
| | 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 | 国投瑞银瑞和沪深300指数 | 国投瑞银瑞和小康沪深300指数 |
| 基金合同生效日 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|----------------------------|---------------|---|---|--------------|---|
| (2009 年 10 月 14 日) 持有的基金份额 | | | | | |
| 期初持有的基金份额 | 10,318,002.32 | - | - | 7,508,107.52 | - |
| 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 | 10,318,002.32 | - | - | 7,508,107.52 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 14.72% | - | - | 15.90% | - |

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

本报告期末及上年度末除本基金基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 | 10,563,035.88 | 30,017.11 | 8,734,785.58 |

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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2016年6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

金额单位：人民币元

| 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(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 603016 | 新宏泰 | 2016-06-23 | 2016-07-01 | 新股未上市 | 8.49 | 8.49 | 912.00 | 7,742.88 | 7,742.88 | - |
| 300520 | 科大国创 | 2016-06-30 | 2016-07-08 | 新股未上市 | 10.05 | 10.05 | 718.00 | 7,215.90 | 7,215.90 | - |
| 002805 | 丰元股份 | 2016-06-29 | 2016-07-07 | 新股未上市 | 5.80 | 5.80 | 971.00 | 5,631.80 | 5,631.80 | - |

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(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-----------|------------|--------------|----|
| 000002 | 万科A | 2015-12-21 | 重大事项停牌 | 18.20 | 2016-07-05 | 19.79 | 80,093.00 | 874,704.03 | 1,457,692.60 | - |
| 000651 | 格力电器 | 2016-02-22 | 重大事项停牌 | 22.07 | - | - | 48,816.00 | 658,148.40 | 1,077,369.12 | - |
| 600019 | 宝钢股份 | 2016-06-27 | 重大事项停牌 | 4.90 | - | - | 46,620.00 | 236,083.10 | 228,438.00 | - |
| 601168 | 西部矿业 | 2016-02-01 | 重大事项停牌 | 6.84 | 2016-07-22 | 6.52 | 30,800.00 | 291,067.59 | 210,672.00 | - |
| 600649 | 城投控股 | 2016-06-20 | 重大事项停牌 | 14.36 | - | - | 13,991.00 | 119,353.72 | 200,910.76 | - |
| 002465 | 海格通信 | 2016-06-13 | 重大事项停牌 | 12.44 | - | - | 16,096.00 | 245,132.95 | 200,234.24 | - |
| 000728 | 国元证券 | 2016-06-08 | 重大事项停牌 | 16.72 | 2016-07-08 | 17.37 | 11,157.00 | 244,526.11 | 186,545.04 | - |
| 002065 | 东华软件 | 2015-12-22 | 重大事项停牌 | 18.72 | 2016-07-04 | 22.59 | 8,060.00 | 135,693.05 | 150,883.20 | - |
| 000415 | 渤海金控 | 2016-02-01 | 重大事项停牌 | 6.82 | - | - | 18,100.00 | 157,560.50 | 123,442.00 | - |
| 002129 | 中环股份 | 2016-04-25 | 重大事项停牌 | 8.29 | 2016-07-04 | - | 13,652.00 | 156,634.83 | 113,175.08 | - |
| 600005 | 武钢股份 | 2016-06-27 | 重大事项停牌 | 2.76 | - | - | 37,800.00 | 211,878.82 | 104,328.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|--------|------------|------------|-------|------------|-------|-----------|------------|-----------|---|
| 000629 | *ST 钒钛 | 2016-05-26 | 重大事项停牌 | 2.39 | - | - | 41,301.00 | 105,881.39 | 98,709.39 | - |
| 601611 | 中国核建 | 2016-06-30 | 股票交易异常波动停牌 | 20.92 | 2016-07-01 | 23.01 | 3,075.00 | 10,670.25 | 64,329.00 | - |
| 603919 | 金徽酒 | 2016-06-06 | 重大事项停牌 | 30.90 | 2016-07-05 | 33.99 | 1,509.00 | 16,508.46 | 46,628.10 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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 | 103,148,917.68 | 90.58 |
| | 其中：股票 | 103,148,917.68 | 90.58 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,716,138.42 | 9.41 |
| 7 | 其他各项资产 | 12,955.65 | 0.01 |
| 8 | 合计 | 113,878,011.75 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 62,244.65 | 0.05 |
| B | 采矿业 | 3,694,292.38 | 3.26 |
| C | 制造业 | 31,782,304.14 | 28.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,811,347.17 | 3.36 |
| E | 建筑业 | 3,058,934.02 | 2.70 |
| F | 批发和零售业 | 2,565,868.06 | 2.26 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,200,050.06 | 2.82 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,212,854.96 | 4.60 |
| J | 金融业 | 36,587,909.29 | 32.26 |
| K | 房地产业 | 5,775,128.41 | 5.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,255,743.43 | 1.11 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 838,472.86 | 0.74 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 139,215.83 | 0.12 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,241,319.00 | 1.98 |
| S | 综合 | 397,389.36 | 0.35 |

| | | |
|----|----------------|-------|
| 合计 | 100,623,073.62 | 88.71 |
|----|----------------|-------|

7.2.2 积极投资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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 494,517.39 | 0.44 |
| C | 制造业 | 1,648,618.30 | 1.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 64,329.00 | 0.06 |
| 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 | 304,428.95 | 0.27 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 13,950.42 | 0.01 |
| 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 | 2,525,844.06 | 2.23 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 144,086.00 | 4,616,515.44 | 4.07 |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 191,786.00 | 2,986,108.02 | 2.63 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 415,026.00 | 2,336,596.38 | 2.06 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 245,300.00 | 2,190,529.00 | 1.93 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 138,617.00 | 2,112,523.08 | 1.86 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 140,710.00 | 2,079,693.80 | 1.83 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 114,186.00 | 1,998,255.00 | 1.76 |
| 8 | 000002 | 万科A | 80,093.00 | 1,457,692.60 | 1.29 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 4,781.00 | 1,395,669.52 | 1.23 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 41,458.00 | 1,348,628.74 | 1.19 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|------------|--------------|
| 1 | 601238 | 广汽集团 | 38,700.00 | 909,063.00 | 0.80 |
| 2 | 002410 | 广联达 | 19,300.00 | 275,990.00 | 0.24 |
| 3 | 601168 | 西部矿业 | 30,800.00 | 210,672.00 | 0.19 |
| 4 | 000937 | 冀中能源 | 34,800.00 | 185,136.00 | 0.16 |
| 5 | 000400 | 许继电气 | 10,800.00 | 166,752.00 | 0.15 |

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 | 601328 | 交通银行 | 2,790,127.96 | 2.07 |
| 2 | 002142 | 宁波银行 | 1,887,421.00 | 1.40 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 1,857,520.00 | 1.38 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,481,932.00 | 1.10 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 1,379,842.00 | 1.02 |
| 6 | 600383 | 金地集团 | 1,201,524.00 | 0.89 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 1,025,371.28 | 0.76 |
| 8 | 601186 | 中国铁建 | 924,455.00 | 0.69 |
| 9 | 601238 | 广汽集团 | 900,668.50 | 0.67 |
| 10 | 000750 | 国海证券 | 863,497.00 | 0.64 |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 779,932.00 | 0.58 |
| 12 | 600895 | 张江高科 | 700,459.00 | 0.52 |
| 13 | 000540 | 中天城投 | 692,193.00 | 0.51 |
| 14 | 000858 | 五 粮 液 | 691,178.00 | 0.51 |
| 15 | 600839 | 四川长虹 | 690,872.00 | 0.51 |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 642,838.88 | 0.48 |
| 17 | 600340 | 华夏幸福 | 641,012.50 | 0.48 |
| 18 | 601377 | 兴业证券 | 610,729.05 | 0.45 |
| 19 | 300315 | 掌趣科技 | 610,670.00 | 0.45 |
| 20 | 000568 | 泸州老窖 | 601,088.93 | 0.45 |

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 | 601009 | 南京银行 | 1,885,319.70 | 1.40 |
| 2 | 601328 | 交通银行 | 1,852,673.00 | 1.37 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 1,729,986.00 | 1.28 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 1,616,478.00 | 1.20 |
| 5 | 601818 | 光大银行 | 1,577,233.00 | 1.17 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 1,479,473.00 | 1.10 |
| 7 | 601186 | 中国铁建 | 926,697.00 | 0.69 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 868,411.91 | 0.64 |
| 9 | 000858 | 五 粮 液 | 811,565.00 | 0.60 |
| 10 | 600060 | 海信电器 | 795,217.00 | 0.59 |
| 11 | 000568 | 泸州老窖 | 720,114.00 | 0.53 |
| 12 | 000728 | 国元证券 | 707,771.72 | 0.53 |
| 13 | 600895 | 张江高科 | 700,867.00 | 0.52 |
| 14 | 000046 | 泛海控股 | 660,382.69 | 0.49 |
| 15 | 603885 | 吉祥航空 | 655,906.00 | 0.49 |
| 16 | 000750 | 国海证券 | 638,590.00 | 0.47 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 17 | 002470 | 金正大 | 620,764.43 | 0.46 |
| 18 | 000540 | 中天城投 | 619,123.00 | 0.46 |
| 19 | 002236 | 大华股份 | 609,055.00 | 0.45 |
| 20 | 600383 | 金地集团 | 574,515.00 | 0.43 |

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

单位：人民币元

| | |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 48,575,551.83 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 53,546,868.14 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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 | 6,722.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,945.03 |
| 5 | 应收申购款 | 4,288.24 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,955.65 |

7.12.4 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处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1 | 000002 | 万科A | 1,457,692.60 | 1.29 | 重大事项停牌 |

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1 | 601168 | 西部矿业 | 210,672.00 | 0.19 | 重大事项停牌 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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 | 6,541 | 10,713.13 | 10,642,572.00 | 15.19% | 59,432,034.01 | 84.81% |
| 国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数 | 1,342 | 18,476.52 | 13,981,886.00 | 56.39% | 10,813,606.00 | 43.61% |
| 国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数 | 1,637 | 15,146.91 | 14,013.00 | 0.06% | 24,781,479.00 | 99.94% |
| 合计 | 9,520 | 12,569.91 | 24,638,471.00 | 20.59% | 95,027,119.01 | 79.41% |

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 | 东方汇智资管—招商银行—东方汇智—道冲基石 1 号资产管理计 | 6,676,831.00 | 26.93% |
| 2 | 东方汇智资管—招商银行—东方汇智—道冲基石 2 号资产管理计 | 3,922,384.00 | 15.82% |
| 3 | 福建道冲投资管理有 | 3,124,032.00 | 12.60% |

| | 限公司一道冲量化 2 号 | | |
|----|--------------|------------|-------|
| 4 | 曹小燕 | 631,160.00 | 2.55% |
| 5 | 曹伟 | 350,645.00 | 1.41% |
| 6 | 张纯英 | 298,753.00 | 1.20% |
| 7 | 夏育林 | 278,540.00 | 1.12% |
| 8 | 王元焜 | 213,800.00 | 0.86% |
| 9 | 刘景如 | 200,000.00 | 0.81% |
| 10 | 黄雪林 | 195,277.00 | 0.79% |

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。

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 | 吴蕙琳 | 1,418,643.00 | 5.72% |
| 2 | 叶海龙 | 1,144,254.00 | 4.61% |
| 3 | 陈为民 | 690,666.00 | 2.79% |
| 4 | 黄晖 | 580,760.00 | 2.34% |
| 5 | 戴雪丽 | 457,900.00 | 1.85% |
| 6 | 李莲华 | 457,565.00 | 1.85% |
| 7 | 涂建坤 | 436,402.00 | 1.76% |
| 8 | 涂光明 | 431,100.00 | 1.74% |
| 9 | 许莉 | 368,886.00 | 1.49% |
| 10 | 崔晓纲 | 340,000.00 | 1.37% |

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 |
|------------------|--------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 国投瑞银瑞和沪深 300 指数 | 130,271.27 | 0.19% |
| | 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 | 130,271.27 | 0.11% |

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。

8.4 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的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门 负责人持有本开放式 基金 | 国投瑞银瑞和沪深 300 指数 | 0 |
| | 国投瑞银瑞和小康沪 深 300 指数 | 0 |

| | | |
|---------------------|-----------------------|---|
| | 国投瑞银瑞和远见沪 深 300 指数 | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有 本开放式基金 | 国投瑞银瑞和沪深 300 指数 | 0 |
| | 国投瑞银瑞和小康沪 深 300 指数 | 0 |
| | 国投瑞银瑞和远见沪 深 300 指数 | 0 |
| | 合计 | 0 |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，本基金基金经理于本报告期末均未持有本基金份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 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 | 72,184,769.89 | 25,436,047.00 | 25,436,047.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,746,425.11 | 520,038.00 | 520,038.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份 额 | 9,856,588.99 | 1,160,593.00 | 1,160,593.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 70,074,606.01 | 24,795,492.00 | 24,795,492.00 |

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，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、刘纯亮先生自 2016 年 2 月 3 日起不再担任管理人总经理；
- 2、王彬女士自 2016 年 2 月 3 日起担任管理人总经理；

3、包爱丽女士自 2016 年 2 月 3 日起不再担任管理人副总经理。

另，储诚忠先生自 2016 年 8 月 12 日起任管理人副总经理。

报告期内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

报告期内无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼。

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的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 民生证券 | 1 | 28,107,052.03 | 27.69% | 9,299.32 | 9.84% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 27,250,105.55 | 26.84% | 781.68 | 0.83% | - |
| 安信证券 | 3 | 17,323,711.00 | 17.07% | 5,234.11 | 5.54% | - |
| 华创证券 | 1 | 9,985,362.02 | 9.84% | 4,866.86 | 5.15% | - |
| 国金证券 | 1 | 5,620,164.54 | 5.54% | 4,812.94 | 5.09% | - |
| 海通证券 | 2 | 5,225,873.20 | 5.15% | 473.88 | 0.50% | - |
| 中信建投证券 | 3 | 5,167,933.69 | 5.09% | 26,176.40 | 27.69% | - |
| 兴业证券 | 1 | 1,482,085.59 | 1.46% | 25,378.54 | 26.84% | - |
| 方正证券 | 1 | 839,337.00 | 0.83% | 16,133.48 | 17.07% | - |
| 东北证券 | 1 | 508,844.74 | 0.50% | 1,380.31 | 1.46% | - |

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|-----------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 民生证券 | 10,360.10 | 100.00% | - | - | - | - |

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

- 2、本基金本报告期未发生交易所回购及权证交易。
- 3、本报告期本基金退租东海证券 1 个交易单元。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日