

**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**

**2017 年半年度报告**

**2017 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：二〇一七年八月二十五日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 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.....                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 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合规守信情况的说明.....              | 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.....             | 11 |
| 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 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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等内容的真实、准确和完整发表意见.....     | 13 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 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.....                      | 16 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 33 |
| 7.2 期末投资目标基金明细.....                          | 34 |
| 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 34 |
| 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股票投资明细.....       | 35 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 37 |
| 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 39 |
| 7.7 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.....      | 39 |
| 7.8 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.....   | 39 |
| 7.9 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.....   | 39 |
| 7.10 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.....     | 39 |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 39 |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 40 |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.13 投资组合报告附注 .....                       | 40        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....               | 41        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....            | 41        |
| 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的情况 .....   | 42        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>42</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                    | <b>42</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                    | 42        |
| 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 .....    | 42        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....         | 42        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                      | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....               | 43        |
| 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 .....       | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....              | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                         | 43        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....            | <b>44</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 ..... | 44        |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                    | <b>44</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                         | 44        |
| 12.2 存放地点 .....                           | 45        |
| 12.3 查阅方式 .....                           | 45        |

## 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       | 前端：161211                         | 后端：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 | 293,030,289.14 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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>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   | <p>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> <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 | 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。 |
|--|--|

## 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<br>负责人 | 姓名   | 刘凯                      | 郭明                  |
|             | 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       |      | 叶柏寿                     | 易会满                 |

## 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 6,844,227.12                         |
| 本期利润          | 37,766,270.67                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1207                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 9.10%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 9.52%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 120,765,892.98                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4121                               |
| 期末基金资产净值      | 413,796,182.12                       |
| 期末基金份额净值      | 1.4121                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | 41.21%                               |

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 | 3.69%    | 0.63%       | 3.17%      | 0.70%         | 0.52% | -0.07% |
| 过去三个月 | 6.78%    | 0.71%       | 6.50%      | 0.77%         | 0.28% | -0.06% |
| 过去六个月 | 9.52%    | 0.61%       | 7.63%      | 0.65%         | 1.89% | -0.04% |
| 过去一年  | 16.89%   | 0.66%       | 10.40%     | 0.70%         | 6.49% | -0.04% |



|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年       | 83.92% | 1.81% | 73.16% | 1.80% | 10.76% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.21% | 1.61% | 24.61% | 1.61% | 16.60% | 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

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

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

（2010 年 4 月 9 日至 2017 年 6 月 30 日）



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、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止 2017 年 6 月底，在公募基金方面，公司共管理 66 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 |        |  |
| 赵建 | 本基金基金经理 | 2015-02-10      | -    | 14     | 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 指数证券投资基金（LOF）、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）、国投瑞银金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金和国投瑞银白银期货证券投资基金（LOF）基金经理。 |

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义

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合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银沪深 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》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

2017 年上半年,中国经济基本延续温和复苏的走势。美、欧为代表的发达国家经济集体回升拉动出口数据改善;在棚户区改造货币化的刺激下,三四线城市房地产销售井喷,带动房地产投资活动持续回升;PPP 项目的落地加速带动了基建相关固定资产投资的回升;以煤炭、钢铁为代表的供给侧改革实施带来了企业盈利的显著回升,进而带动产业库存回补和设备更新需求。房地产上游以煤炭、有色、钢铁为代表的盈利显著回升,房地产下游的家电、家具、轻工行业维持高增长。

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 1.4121 元，本报告期份额净值增长率为 9.52%，同期业绩比较基准收益率为 7.63%。

#### 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，预计货币政策维持稳健中性，金融市场改革稳步推进，中国经济强大的体量和韧性，使得经济总体仍将平稳运行，金融市场的流动性总体上仍然是相对平稳。同时，许多行业经历过去几年行业整合，已经诞生出一批通过长期积累而具备核心优势的公司，这些公司如果匹配较好的企业盈利和较低的估值将具备投资价值。

#### 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，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种的估值数据。

#### **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 6,844,227.12 元，期末可供分配利润为 120,765,892.98 元。本报告期本基金未进行收益分配。

### **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**

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。

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 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 29,026,982.53                  | 27,677,644.36                    |
| 结算备付金           |            | -                              | 660,839.09                       |
| 存出保证金           |            | 29,925.31                      | 63,385.07                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 386,974,444.27                 | 442,078,940.87                   |
| 其中：股票投资         |            | 11,553,093.57                  | 11,917,146.05                    |
| 基金投资            |            | 375,421,350.70                 | 430,161,794.82                   |
| 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         |            | -                              | 54,137.16                        |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 4,826.92                       | 6,434.81                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 116,020.13                     | 41,921.77                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 416,152,199.16                 | 470,583,303.13                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 4,617.75                       | -                                |
| 应付赎回款           |            | 2,024,658.08                   | 355,381.27                       |
| 应付管理人报酬         |            | 18,899.48                      | 28,461.33                        |
| 应付托管费           |            | 4,094.87                       | 6,166.64                         |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 23,746.69                      | 101,534.67                       |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 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  | 280,000.17     | 360,727.21     |
| 负债合计          |          | 2,356,017.04   | 852,271.12     |
| <b>所有者权益：</b> |          | -              | -              |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 293,030,289.14 | 364,306,612.72 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 120,765,892.98 | 105,424,419.29 |
| 所有者权益合计       |          | 413,796,182.12 | 469,731,032.01 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 416,152,199.16 | 470,583,303.13 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4121 元，基金份额总额 293,030,289.14 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>38,277,300.40</b>                     | <b>-53,725,510.24</b>                         |
| 1.利息收入                |          | 98,130.28                                | 171,142.00                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 98,130.28                                | 171,142.00                                    |
| 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）      |          | 7,171,709.50                             | -416,738.12                                   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | -73,903.70                               | -840,049.73                                   |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13 | 7,156,628.23                             | 286,838.04                                    |
| 债券投资收益                | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益            |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益               |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16 | 88,984.97                                | 136,473.57                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 30,922,043.55                            | -53,519,382.60                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -  | -   |

|                            |          |                      |                       |
|----------------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18 | 85,417.07            | 39,468.48             |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>511,029.73</b>    | <b>366,267.75</b>     |
| 1. 管理人报酬                   |          | 113,589.12           | 116,242.48            |
| 2. 托管费                     |          | 24,610.97            | 25,185.82             |
| 3. 销售服务费                   |          | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19 | 194,119.15           | 42,598.55             |
| 5. 利息支出                    |          | -                    | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                    | -                     |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20 | 178,710.49           | 182,240.90            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>37,766,270.67</b> | <b>-54,091,777.99</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>37,766,270.67</b> | <b>-54,091,777.99</b> |

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 364,306,612.72                             | 105,424,419.29 | 469,731,032.01  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 37,766,270.67  | 37,766,270.67   |
| 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）      | -71,276,323.58                             | -22,424,796.98 | -93,701,120.56  |
| 其中：1.基金申购款                             | 9,221,852.76                               | 3,055,054.27   | 12,276,907.03   |
| 2.基金赎回款                                | -80,498,176.34                             | -25,479,851.25 | -105,978,027.59 |
| 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）                        | 293,030,289.14                             | 120,765,892.98 | 413,796,182.12  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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<br>(基金净值)                                | 354,215,906.15 | 127,628,347.36 | 481,844,253.51 |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本期<br>利润)                   | -              | -54,091,777.99 | -54,091,777.99 |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动<br>数(净值减少以“-”号填<br>列)      | -13,826,082.95 | -2,709,571.22  | -16,535,654.17 |
| 其中：1.基金申购款   | 22,626,096.28  | 3,949,146.15   | 26,575,242.43  |
| 2.基金赎回款  | -36,452,179.23 | -6,658,717.37  | -43,110,896.60 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -              | -              | -              |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 340,389,823.20 | 70,826,998.15  | 411,216,821.35 |

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:  $95\% \times \text{沪深 300 金融地产指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

#### **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 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **6.4.5 会计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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 29,026,982.53          |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 定期存款           | -             |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -             |
| 存款期限 3 个月-1 年  | -             |
| 存款期限 1 个月以内    | -             |
| 其他存款           | -             |
| 合计             | 29,026,982.53 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                |               |
|-------------------|------------------------|----------------|---------------|
|                   | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票                | 11,074,275.53          | 11,553,093.57  | 478,818.04    |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 319,835,179.55         | 375,421,350.70 | 55,586,171.15 |
| 其他                | -                      | -              | -             |
| 合计                | 330,909,455.08         | 386,974,444.27 | 56,064,989.19 |

#### 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 4,814.21               |
| 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  | 0.56                   |
| 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         | 12.15                  |
| 合计         | 4,826.92               |

#### 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 23,746.69              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 23,746.69              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 1,481.68               |
| 审计费用        | 29,752.78              |
| 预提信息披露费     | 248,765.71             |
| 合计          | 280,000.17             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 364,306,612.72                        | 364,306,612.72 |
| 本期申购          | 9,221,852.76                          | 9,221,852.76   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -80,498,176.34                        | -80,498,176.34 |
| 本期末           | 293,030,289.14                        | 293,030,289.14 |

#### 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           | 162,071,686.04 | -56,647,266.75 | 105,424,419.29 |
| 本期利润           | 6,844,227.12   | 30,922,043.55  | 37,766,270.67  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -32,217,589.06 | 9,792,792.08   | -22,424,796.98 |
| 其中：基金申购款       | 4,227,091.92   | -1,172,037.65  | 3,055,054.27   |
| 基金赎回款          | -36,444,680.98 | 10,964,829.73  | -25,479,851.25 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 136,698,324.10 | -15,932,431.12 | 120,765,892.98 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 96,138.08                             |
| 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 | 164.70                                |
| 其他        | 1,827.50                              |
| 合计        | 98,130.28                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 93,734,292.73                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 93,808,196.43                         |
| 买卖股票差价收入   | -73,903.70                            |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 91,904,211.69                         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 84,747,583.46                         |
| 基金投资收益        | 7,156,628.23                          |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 88,984.97                             |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 88,984.97                             |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称      | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 30,922,043.55                         |

|            |               |
|------------|---------------|
| ——股票投资     | 914,904.21    |
| ——债券投资     | -             |
| ——资产支持证券投资 | -             |
| ——基金投资     | 30,007,139.34 |
| ——贵金属投资    | -             |
| ——其他       | -             |
| 2.衍生工具     | -             |
| ——权证投资     | -             |
| 3.其他       | -             |
| 合计         | 30,922,043.55 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 85,417.07                  |
| 合计      | 85,417.07                  |

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 190,031.08                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 基金交易费用    | 4,088.07                   |
| 合计        | 194,119.15                 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用  | 29,752.78                  |
| 信息披露费 | 148,765.71                 |
| 资金汇划费 | 192.00                     |
| 其他费用  | -                          |
| 合计    | 178,710.49                 |

### 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

本报告期内，本基金新增与基金管理人受同一实际控制的关联方安信证券股份有限公司。

### 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

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<br>2017年1月1日至2017年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 113,589.12                     | 116,242.48                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | 460,369.53                     | 439,973.80                          |

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<br>2017年1月1日至2017年<br>6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |           |
|----|--------------------------------|-----------|-------------------------------------|-----------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费                 | 24,610.97 |                                     | 25,185.82 |

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 = 前一日的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<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30日 |               | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月<br>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                         | 29,026,982.53 | 96,138.08                           | 28,289,751.70 |

#### 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 2017 年 6 月 30 日, 本基金持有 215,116,520.00 份目标 ETF 基金份额, 占其总份额的比例为 95.24% (2016 年 12 月 31 日, 本基金持有 272,116,520.00 份目标 ETF 基金份额, 占其总份额的比例为 95.86%)。

#### 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 (2017 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.1.1 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。

###### 6.4.12.1.2 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、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。本基金的活期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。本基金在存放定期存款前, 均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。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 2017 年 6 月 30 日,

本基金未持有债券 (2016 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 2017 年 6 月 30 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息, 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<br>2017 年 6 月 30<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|---------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                        |               |       |       |                |                |
| 银行存款                      | 29,026,982.53 | -     | -     | -              | 29,026,982.53  |
| 结算备付金                     | -             | -     | -     | -              | -              |
| 存出保证金                     | 29,925.31     | -     | -     | -              | 29,925.31      |
| 交易性金融资产                   | -             | -     | -     | 386,974,444.27 | 386,974,444.27 |
| 衍生金融资产                    | -             | -     | -     | -              | -              |
| 买入返售金融资产                  | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应收证券清算款                   | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应收利息                      | -             | -     | -     | 4,826.92       | 4,826.92       |
| 应收股利                      | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应收申购款                     | -             | -     | -     | 116,020.13     | 116,020.13     |
| 递延所得税资产                   | -             | -     | -     | -              | -              |
| 其他资产                      | -             | -     | -     | -              | -              |
| 资产总计                      | 29,056,907.84 | -     | -     | 387,095,291.32 | 416,152,199.16 |
| 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                   | -             | -     | -     | 4,617.75       | 4,617.75       |
| 应付赎回款                     | -             | -     | -     | 2,024,658.08   | 2,024,658.08   |
| 应付管理人报酬                   | -             | -     | -     | 18,899.48      | 18,899.48      |
| 应付托管费                     | -             | -     | -     | 4,094.87       | 4,094.87       |
| 应付销售服务费                   | -             | -     | -     | -              | -              |
| 应付交易费用                    | -             | -     | -     | 23,746.69      | 23,746.69      |
| 应交税费                      | -             | -     | -     | -              | -              |

|                             |               |             |             |                 |                |
|-----------------------------|---------------|-------------|-------------|-----------------|----------------|
| 应付利息                        | -             | -           | -           | -               | -              |
| 应付利润                        | -             | -           | -           | -               | -              |
| 递延所得税负债                     | -             | -           | -           | -               | -              |
| 其他负债                        | -             | -           | -           | 280,000.17      | 280,000.17     |
| 负债总计                        | -             | -           | -           | 2,356,017.04    | 2,356,017.04   |
| 利率敏感度缺口                     | 29,056,907.84 | -           | -           | -384,739,274.28 | 413,796,182.12 |
| <b>上年度末<br/>2016年12月31日</b> | <b>1年以内</b>   | <b>1-5年</b> | <b>5年以上</b> | <b>不计息</b>      | <b>合计</b>      |
| 资产                          |               |             |             |                 |                |
| 银行存款                        | 27,677,644.36 | -           | -           | -               | 27,677,644.36  |
| 结算备付金                       | 660,839.09    | -           | -           | -               | 660,839.09     |
| 存出保证金                       | 63,385.07     | -           | -           | -               | 63,385.07      |
| 交易性金融资产                     | -             | -           | -           | 442,078,940.87  | 442,078,940.87 |
| 衍生金融资产                      | -             | -           | -           | -               | -              |
| 买入返售金融资产                    | -             | -           | -           | -               | -              |
| 应收证券清算款                     | -             | -           | -           | 54,137.16       | 54,137.16      |
| 应收利息                        | -             | -           | -           | 6,434.81        | 6,434.81       |
| 应收股利                        | -             | -           | -           | -               | -              |
| 应收申购款                       | -             | -           | -           | 41,921.77       | 41,921.77      |
| 递延所得税资产                     | -             | -           | -           | -               | -              |
| 其他资产                        | -             | -           | -           | -               | -              |
| 资产总计                        | 28,401,868.52 | -           | -           | 442,181,434.61  | 470,583,303.13 |
| 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   | -             | - | - | 355,381.27      | 355,381.27     |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 28,461.33       | 28,461.33      |
| 应付托管费   | -             | - | - | 6,166.64        | 6,166.64       |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | -               | -              |
| 应付交易费用  | -             | - | - | 101,534.67      | 101,534.67     |
| 应交税费    | -             | - | - | -               | -              |
| 应付利息    | -             | - | - | -               | -              |
| 应付利润    | -             | - | - | -               | -              |
| 递延所得税负债 | -             | - | - | -               | -              |
| 其他负债    | -             | - | - | 360,727.21      | 360,727.21     |
| 负债总计    | -             | - | - | 852,271.12      | 852,271.12     |
| 利率敏感度缺口 | 28,401,868.52 | - | - | -441,329,163.49 | 469,731,032.01 |

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 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（2016 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<br>2017 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                              |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基<br>金资<br>产净<br>值比<br>例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 11,553,093.57          | 2.79                     | 11,917,146.05            | 2.54                         |
| 交易性金融资产—基金投资  | 375,421,350.70         | 90.73                    | 430,161,794.82           | 91.58                        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 其他            | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 合计            | 386,974,444.27         | 93.52                    | 442,078,940.87           | 94.11                        |

#### 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：人民币元） |                          |
|    |                     | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 业绩比较基准上升 5%      | 19,217,857.46               | 23,125,927.09            |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%      | -19,217,857.46              | -23,125,927.09           |

注：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)。



#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 10 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(2) 除以上事项外，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              | 11,553,093.57  | 2.78          |
|    | 其中：股票             | 11,553,093.57  | 2.78          |
| 2  | 基金投资              | 375,421,350.70 | 90.21         |
| 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 | 29,026,982.53  | 6.98   |
| 8 | 其他各项资产       | 150,772.36     | 0.04   |
| 9 | 合计           | 416,152,199.16 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称   | 基金类型 | 运作方式   | 管理人          | 公允价值           | 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 | 375,421,350.70 | 90.73         |

## 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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              | -            | -             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -             |
| E  | 建筑业              | 20,864.00    | 0.01          |
| 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              | 9,986,404.80 | 2.41          |
| K  | 房地产业             | 1,523,880.77 | 0.37          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -             |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| 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            | 21,944.00     | 0.01 |
|   | 合计            | 11,553,093.57 | 2.79 |

### 7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 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<br>净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|------------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 31,100.00  | 1,542,871.00 | 0.37             |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 29,200.00  | 698,172.00   | 0.17             |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 35,500.00  | 598,530.00   | 0.14             |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 66,800.00  | 549,096.00   | 0.13             |
| 5  | 000002 | 万科A  | 20,400.00  | 509,388.00   | 0.12             |
| 6  | 601328 | 交通银行 | 77,400.00  | 476,784.00   | 0.12             |
| 7  | 600000 | 浦发银行 | 31,850.00  | 402,902.50   | 0.10             |
| 8  | 601288 | 农业银行 | 107,800.00 | 379,456.00   | 0.09             |
| 9  | 600030 | 中信证券 | 22,200.00  | 377,844.00   | 0.09             |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 22,800.00  | 338,580.00   | 0.08             |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 60,600.00  | 318,150.00   | 0.08             |
| 12 | 601169 | 北京银行 | 34,362.00  | 315,099.54   | 0.08             |
| 13 | 601601 | 中国太保 | 9,056.00   | 306,726.72   | 0.07             |
| 14 | 601211 | 国泰君安 | 12,700.00  | 260,477.00   | 0.06             |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 24,300.00  | 228,177.00   | 0.06             |
| 16 | 601988 | 中国银行 | 59,700.00  | 220,890.00   | 0.05             |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 20,500.00  | 204,385.00   | 0.05             |
| 18 | 601818 | 光大银行 | 44,800.00  | 181,440.00   | 0.04             |
| 19 | 601688 | 华泰证券 | 9,200.00   | 164,680.00   | 0.04             |
| 20 | 600015 | 华夏银行 | 17,720.00  | 163,378.40   | 0.04             |
| 21 | 000776 | 广发证券 | 8,300.00   | 143,175.00   | 0.03             |
| 22 | 001979 | 招商蛇口 | 6,700.00   | 143,112.00   | 0.03             |

|    |        |      |           |            |      |
|----|--------|------|-----------|------------|------|
| 23 | 600958 | 东方证券 | 8,600.00  | 119,626.00 | 0.03 |
| 24 | 601336 | 新华保险 | 2,300.00  | 118,220.00 | 0.03 |
| 25 | 601939 | 建设银行 | 19,200.00 | 118,080.00 | 0.03 |
| 26 | 601901 | 方正证券 | 11,600.00 | 115,188.00 | 0.03 |
| 27 | 601009 | 南京银行 | 10,200.00 | 114,342.00 | 0.03 |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 3,400.00  | 114,172.00 | 0.03 |
| 29 | 600999 | 招商证券 | 6,400.00  | 110,208.00 | 0.03 |
| 30 | 002142 | 宁波银行 | 5,600.00  | 108,080.00 | 0.03 |
| 31 | 601377 | 兴业证券 | 13,200.00 | 98,076.00  | 0.02 |
| 32 | 002736 | 国信证券 | 6,900.00  | 91,425.00  | 0.02 |
| 33 | 000783 | 长江证券 | 9,300.00  | 88,071.00  | 0.02 |
| 34 | 601628 | 中国人寿 | 3,100.00  | 83,638.00  | 0.02 |
| 35 | 601788 | 光大证券 | 5,500.00  | 82,115.00  | 0.02 |
| 36 | 600606 | 绿地控股 | 10,300.00 | 80,546.00  | 0.02 |
| 37 | 601099 | 太平洋  | 19,300.00 | 77,586.00  | 0.02 |
| 38 | 601555 | 东吴证券 | 6,800.00  | 76,364.00  | 0.02 |
| 39 | 600383 | 金地集团 | 6,400.00  | 73,408.00  | 0.02 |
| 40 | 600705 | 中航资本 | 12,600.00 | 71,190.00  | 0.02 |
| 41 | 600109 | 国金证券 | 6,000.00  | 70,320.00  | 0.02 |
| 42 | 600816 | 安信信托 | 5,040.00  | 68,493.60  | 0.02 |
| 43 | 000166 | 申万宏源 | 11,640.00 | 65,184.00  | 0.02 |
| 44 | 000728 | 国元证券 | 4,900.00  | 59,878.00  | 0.01 |
| 45 | 000540 | 中天金融 | 8,000.00  | 55,600.00  | 0.01 |
| 46 | 601198 | 东兴证券 | 3,200.00  | 55,168.00  | 0.01 |
| 47 | 601998 | 中信银行 | 8,700.00  | 54,723.00  | 0.01 |
| 48 | 600208 | 新潮中宝 | 12,100.00 | 54,450.00  | 0.01 |
| 49 | 601229 | 上海银行 | 1,900.00  | 48,526.00  | 0.01 |
| 50 | 002146 | 荣盛发展 | 4,900.00  | 48,363.00  | 0.01 |
| 51 | 600663 | 陆家嘴  | 2,000.00  | 47,280.00  | 0.01 |
| 52 | 002673 | 西部证券 | 3,302.00  | 46,954.44  | 0.01 |
| 53 | 601155 | 新城控股 | 2,500.00  | 46,350.00  | 0.01 |
| 54 | 000750 | 国海证券 | 8,350.00  | 45,925.00  | 0.01 |
| 55 | 002500 | 山西证券 | 4,700.00  | 45,026.00  | 0.01 |
| 56 | 600369 | 西南证券 | 7,900.00  | 44,319.00  | 0.01 |
| 57 | 000686 | 东北证券 | 3,900.00  | 39,195.00  | 0.01 |
| 58 | 600649 | 城投控股 | 3,527.00  | 37,068.77  | 0.01 |
| 59 | 600919 | 江苏银行 | 3,600.00  | 33,444.00  | 0.01 |
| 60 | 600376 | 首开股份 | 2,900.00  | 33,176.00  | 0.01 |
| 61 | 601997 | 贵阳银行 | 2,000.00  | 31,620.00  | 0.01 |
| 62 | 600909 | 华安证券 | 3,100.00  | 31,279.00  | 0.01 |
| 63 | 000627 | 天茂集团 | 3,600.00  | 29,088.00  | 0.01 |
| 64 | 000671 | 阳光城  | 4,600.00  | 26,772.00  | 0.01 |
| 65 | 000718 | 苏宁环球 | 4,300.00  | 25,198.00  | 0.01 |

|    |        |      |          |           |      |
|----|--------|------|----------|-----------|------|
| 66 | 000402 | 金融街  | 2,100.00 | 24,612.00 | 0.01 |
| 67 | 601881 | 中国银河 | 1,900.00 | 22,534.00 | 0.01 |
| 68 | 601375 | 中原证券 | 2,200.00 | 22,132.00 | 0.01 |
| 69 | 600895 | 张江高科 | 1,300.00 | 21,944.00 | 0.01 |
| 70 | 000961 | 中南建设 | 3,200.00 | 20,864.00 | 0.01 |
| 71 | 600926 | 杭州银行 | 1,100.00 | 16,335.00 | 0.00 |
| 72 | 002797 | 第一创业 | 1,060.00 | 9,762.60  | 0.00 |
| 73 | 002839 | 张家港行 | 500.00   | 7,860.00  | 0.00 |

## 7.5 报告期内股票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  | 601229 | 上海银行 | 49,704.00 | 0.01            |
| 2  | 600606 | 绿地控股 | 43,725.00 | 0.01            |
| 3  | 600919 | 江苏银行 | 36,660.00 | 0.01            |
| 4  | 601555 | 东吴证券 | 34,816.00 | 0.01            |
| 5  | 601997 | 贵阳银行 | 33,285.00 | 0.01            |
| 6  | 002500 | 山西证券 | 32,725.00 | 0.01            |
| 7  | 600909 | 华安证券 | 32,043.00 | 0.01            |
| 8  | 600048 | 保利地产 | 28,391.00 | 0.01            |
| 9  | 600109 | 国金证券 | 26,565.00 | 0.01            |
| 10 | 600208 | 新湖中宝 | 26,244.00 | 0.01            |
| 11 | 002736 | 国信证券 | 25,740.00 | 0.01            |
| 12 | 601881 | 中国银河 | 23,880.00 | 0.01            |
| 13 | 601375 | 中原证券 | 23,804.00 | 0.01            |
| 14 | 002142 | 宁波银行 | 23,699.00 | 0.01            |
| 15 | 000961 | 中南建设 | 22,372.00 | 0.00            |
| 16 | 601998 | 中信银行 | 22,212.00 | 0.00            |
| 17 | 601788 | 光大证券 | 19,552.00 | 0.00            |
| 18 | 000728 | 国元证券 | 19,536.00 | 0.00            |
| 19 | 600926 | 杭州银行 | 18,612.00 | 0.00            |
| 20 | 601099 | 太平洋  | 15,276.00 | 0.00            |

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，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。

### 7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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   | 9,903,453.93 | 2.11            |
| 2  | 601166 | 兴业银行   | 5,230,789.00 | 1.11            |
| 3  | 600016 | 民生银行   | 5,042,349.00 | 1.07            |
| 4  | 600036 | 招商银行   | 4,819,277.06 | 1.03            |
| 5  | 601328 | 交通银行   | 3,968,544.00 | 0.84            |
| 6  | 600000 | 浦发银行   | 3,370,231.40 | 0.72            |
| 7  | 000002 | 万科 A   | 3,364,434.20 | 0.72            |
| 8  | 600030 | 中信证券   | 3,163,309.00 | 0.67            |
| 9  | 601288 | 农业银行   | 3,012,832.00 | 0.64            |
| 10 | 600837 | 海通证券   | 3,000,875.00 | 0.64            |
| 11 | 601169 | 北京银行   | 2,873,263.28 | 0.61            |
| 12 | 601398 | 工商银行   | 2,458,677.00 | 0.52            |
| 13 | 601601 | 中国太保   | 2,282,818.95 | 0.49            |
| 14 | 601211 | 国泰君安   | 2,166,263.00 | 0.46            |
| 15 | 000001 | 平安银行   | 1,902,720.20 | 0.41            |
| 16 | 601988 | 中国银行   | 1,822,431.00 | 0.39            |
| 17 | 600048 | 保利地产   | 1,628,622.00 | 0.35            |
| 18 | 601818 | XD 光大银 | 1,562,250.00 | 0.33            |
| 19 | 601688 | 华泰证券   | 1,444,356.20 | 0.31            |
| 20 | 600015 | 华夏银行   | 1,421,715.10 | 0.30            |

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。

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 672,295.00    |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 93,734,292.73 |

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。

## 7.6 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。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 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

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中，持有“中信证券”市值 377,844.00 元，占基金资产净值 0.09%。根据中信证券 2017 年 5 月 24 日公告，该公司因未按照规定与客户签订合同，收到中国证监会《行政处罚事先告知书》，中国证监会拟决定对该公司责令改正，给予警告，没收违法所得 61,655,849.78 元，并处以罚款 308,279,248.09 元。

此外，本基金投资的前十名证券中，持有“海通证券”市值 338,580.00 元，占基金资产净值 0.08%。根据海通证券 2016 年 11 月 28 日公告，该公司因未按规定审查、了解客户真实身份，被中国证监会责令整改，给予警告，处以没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款；同时，根据海通证券 2017 年 5 月 24 日公告，该公司因未按照规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款，于 2017 年 5 月 23 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》，中国证监会拟决定对该公司责令改正，给予警告，没收违法所得 509,653.15 元，并处以罚款 2,548,265.75 元。基金管理人认为，该公司上述被调查事项有利于公司加强内部管理，公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对该公司经营活动未产生实质性影响，不改变该公司基本面。

本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

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

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   | 29,925.31 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |



|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利  | -          |
| 4 | 应收利息  | 4,826.92   |
| 5 | 应收申购款 | 116,020.13 |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 150,772.36 |

#### 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处于转股期的可转债。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票投资中不存在流通受限情况。

#### 7.13.6 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

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 17,024   | 17,212.78     | 67,052,390.82 | 22.88%     | 225,977,898.32 | 77.12%     |

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 | 257,713.54 | 0.09%    |

### 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的情况

| 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 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                  | 364,306,612.72   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 9,221,852.76     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 80,498,176.34    |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 293,030,289.14   |

### 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

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 |            |
|--------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|
|        |        | 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 |
| 中信建投证券 | 3      | 32,645,664.75 | 34.58%       | 30,403.11 | 34.58%     |
| 东方证券   | 1      | 28,371,309.96 | 30.05%       | 26,422.11 | 30.05%     |
| 民生证券   | 1      | 10,833,664.02 | 11.48%       | 10,089.60 | 11.48%     |
| 方正证券   | 1      | 9,222,595.00  | 9.77%        | 8,588.97  | 9.77%      |
| 东吴证券   | 1      | 5,942,419.00  | 6.29%        | 5,534.25  | 6.29%      |
| 瑞银证券   | 2      | 4,049,562.00  | 4.29%        | 3,771.45  | 4.29%      |
| 国元证券   | 2      | 3,341,373.00  | 3.54%        | 3,111.87  | 3.54%      |

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、本报告期本基金未发生交易所债券、回购及权证交易。

3、本基金本报告期退租德邦证券 1 个交易单元。

#### 10.8 其他重大事件

报告期内本基金无其他重大事件。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 产品特有风险   |
|--|
| <p>投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时，可能出现以下风险：</p> <p>1、赎回申请延期办理的风险<br/>单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险<br/>单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；单一投资者大额赎回时，相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。</p> <p>3、基金投资策略难以实现的风险<br/>单一投资者大额赎回后，可能使基金资产净值显著降低，从而使基金在拟参与银行间市场交易等投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。</p> <p>4、基金财产清算（或转型）的风险<br/>根据本基金基金合同的约定，基金合同生效后的存续期内，若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。单一投资者大额赎回后，可能造成基金资产净值大幅缩减而导致本基金转换运作方式、与其他基金合并或基金合同终止等情形。</p> <p>5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险<br/>由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高，在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时，单一机构投资者将拥有高的投票权重。</p> |

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## 12 备查文件目录

### 12.1 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 2017 年半年度报告原文

## 12.2 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>

## 12.3 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

二〇一七年八月二十五日