

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

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 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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47

8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金		
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
下属分级基金的场内简称	瑞和 300	瑞和小康	瑞和远见
下属分级基金的交易代码	161207	150008	150009
报告期末下属分级基金的份额 总额	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	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	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
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	http://www.ubssdic.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

2.5 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(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
本期加权平均净值利润率	-16.23%
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)
期末可供分配利润	-6,457,994.19
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.20%

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	附注号	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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,733,650.30
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		113,878,011.75	135,327,113.92
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	119,890,266.89	123,198,406.89
未分配利润	6.4.7.10	-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	附注号	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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-3,168,277.34	100,015,003.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	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	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	975,105.11	1,428,757.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-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）	6.4.7.17	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	6.4.7.18	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	6.4.7.19	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	-	58,516,643.95	58,516,643.95

的基金净值变动数(本期利润)			
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% × 沪深 300 指数收益率 + 5% × 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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	10,563,035.88
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	10,563,035.88

注：1、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2、本基金本期未发生定期存款提前支取。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	106,311,305.89	103,148,917.68	-3,162,388.21
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	106,311,305.89	103,148,917.68	-3,162,388.21

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,880.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2.70
应收结算备付金利息	62.01
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	-
合计	1,945.03

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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	51,708.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	51,708.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.48
审计费用	29,835.26
预提信息披露费	249,178.12
合计	279,023.86

6.4.7.9 实收基金

国投瑞银瑞和沪深 300 指数

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	72,184,769.89	70,372,603.24
本期申购	7,746,425.11	7,549,292.37
本期赎回（以“-”号填列）	-9,856,588.99	-9,609,779.19
本期末	70,074,606.01	68,312,116.42

国投瑞银瑞和小康沪深 300 指数

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	25,436,047.00	28,730,145.73
本期申购	520,038.00	525,192.47
本期末	24,795,492.00	28,083,241.71

国投瑞银瑞和远见沪深 300 指数

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	25,436,047.00	24,095,657.92
本期申购	520,038.00	487,721.43
本期赎回（以“-”号填列）	-1,160,593.00	-1,088,470.59
本期末	24,795,492.00	23,494,908.76

注：申购含配对转换入份额；赎回含配对转换出份额。

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	10,983,083.70	618,875.94	11,601,959.64
本期利润	-3,176,729.94	-15,086,707.35	-18,263,437.29
本期基金份额交易产生的变动数	-287,596.37	491,079.83	203,483.46
其中：基金申购款	539,845.30	-800,667.07	-260,821.77
基金赎回款	-827,441.67	1,291,746.90	464,305.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,518,757.39	-13,976,751.58	-6,457,994.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	30,017.11
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	786.75
其他	11,793.89
合计	42,597.75

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	53,546,868.14
减：卖出股票成本总额	56,715,145.48
买卖股票差价收入	-3,168,277.34

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,360.10

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,999.97
减：应收利息总额	1.25
买卖债券差价收入	2,358.88

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	975,105.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	975,105.11

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-15,086,707.35
——股票投资	-15,086,707.35
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-15,086,707.35

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	9,184.37
合计	9,184.37

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	157,091.05
银行间市场交易费用	-

合计	157,091.05
----	------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
资金汇划费	353.00
其他费用	18,000.00
合计	197,366.38

注：本基金标的指数使用费由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告送出日，本基金无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

本报告期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10.2 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 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：

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

6.4.10.2.2 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：

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

6.4.10.3 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

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	10,318,002	-	-	7,508,107.	-

份额	.32			52	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	14.72%	-	-	15.90%	-

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。

6.4.10.5 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 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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
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
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	10.05	10.05	718.00	7,215.90	7,215.90

				市					
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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只被动型指数证券投资基金，投资的标的指数为沪深 300 指数，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。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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；基金在银行间同业市场仅与达到本基金的基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券

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瑞和沪深 300 指数份额，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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,563,035.88	-	-	-	10,563,035.88
结算备付金	153,102.54	-	-	-	153,102.54
存出保证金	6,722.38	-	-	-	6,722.38
交易性金融资产	-	-	-	103,148,917.68	103,148,917.68
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	-	-	-	1,945.03	1,945.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,288.24	4,288.24
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,722,860.80	-	-	103,155,150.95	113,878,011.75

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	2,778.56
应付管理人报酬	-	-	-	91,990.19	91,990.19
应付托管费	-	-	-	20,237.85	20,237.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	51,708.59	51,708.59
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	279,023.86
负债总计	-	-	-	445,739.05	445,739.05
利率敏感度缺口	10,722,860.80	-	-	102,709,411.90	113,432,272.70
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,047,997.32	-	-	-	7,047,997.32
结算备付金	143,594.79	-	-	-	143,594.79
存出保证金	20,862.84	-	-	-	20,862.84
交易性金融资产	-	-	-	126,375,218.68	126,375,218.68
应收证券清算款	-	-	-	1,733,650.30	1,733,650.30
应收利息	-	-	-	1,810.79	1,810.79
应收申购款	-	-	-	3,979.20	3,979.20
资产总计	7,212,454.95	-	-	128,114,658.97	135,327,113.92

					92
负债					
应付赎回款	-	-	-	34,781.30	34,781.30
应付管理人报酬	-	-	-	116,085.65	116,085.65
应付托管费	-	-	-	25,538.85	25,538.85
应付交易费用	-	-	-	90,274.37	90,274.37
其他负债	-	-	-	260,067.22	260,067.22
负债总计	-	-	-	526,747.39	526,747.39
利率敏感度缺口	7,212,454.95	-	-	127,587,911.58	134,800,366.53

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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 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，以有效控制基金的跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 85%-95%；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%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	103,148,917.68	90.93	126,375,218.68	93.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	103,148,917.68	90.93	126,375,218.68	93.75

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	6,085,847.89	7,116,710.11
	业绩比较基准下降 5%	-6,085,847.89	-7,116,710.11

注：本基金的业绩比较基准为 95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	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所有股票投资明细

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
11	600030	中信证券	74,128.00	1,203,097.44	1.06
12	600837	海通证券	76,309.00	1,176,684.78	1.04
13	601288	农业银行	361,119.00	1,155,580.80	1.02
14	000651	格力电器	48,816.00	1,077,369.12	0.95
15	601169	北京银行	95,442.00	989,733.54	0.87
16	002594	比亚迪	15,846.00	966,764.46	0.85
17	600887	伊利股份	56,890.00	948,356.30	0.84
18	601238	广汽集团	38,700.00	909,063.00	0.80
19	600340	华夏幸福	33,842.00	825,067.96	0.73
20	001979	招商蛇口	56,913.00	811,010.25	0.71
21	601601	中国太保	29,610.00	800,654.40	0.71
22	601766	中国中车	86,334.00	791,682.78	0.70
23	600839	四川长虹	177,271.00	783,537.82	0.69
24	600100	同方股份	52,167.00	780,418.32	0.69
25	600900	长江电力	62,106.00	775,703.94	0.68
26	601377	兴业证券	104,877.00	775,041.03	0.68
27	601901	方正证券	99,054.00	758,753.64	0.67
28	601668	中国建筑	141,528.00	752,928.96	0.66
29	600795	国电电力	256,865.00	752,614.45	0.66
30	600383	金地集团	70,961.00	735,155.96	0.65
31	000333	美的集团	30,010.00	711,837.20	0.63
32	000413	东旭光电	80,398.00	690,618.82	0.61
33	600109	国金证券	49,225.00	663,553.00	0.58
34	600547	山东黄金	16,604.00	646,061.64	0.57
35	601939	建设银行	133,683.00	634,994.25	0.56
36	600104	上汽集团	31,269.00	634,448.01	0.56
37	601988	中国银行	197,415.00	633,702.15	0.56
38	000895	双汇发展	28,872.00	602,847.36	0.53
39	601688	华泰证券	30,831.00	583,322.52	0.51
40	601818	光大银行	148,864.00	559,728.64	0.49
41	000001	平安银行	64,334.00	559,705.80	0.49
42	601989	中国重工	87,931.00	556,603.23	0.49
43	600170	上海建工	143,169.00	548,337.27	0.48

44	600276	恒瑞医药	13,295.00	533,262.45	0.47
45	000686	东北证券	40,794.00	526,650.54	0.46
46	600739	辽宁成大	33,654.00	523,992.78	0.46
47	600048	保利地产	60,293.00	520,328.59	0.46
48	300315	掌趣科技	49,300.00	517,157.00	0.46
49	000725	京东方 A	223,797.00	516,971.07	0.46
50	601992	金隅股份	65,764.00	509,671.00	0.45
51	000793	华闻传媒	51,481.00	508,632.28	0.45
52	300251	光线传媒	43,818.00	506,536.08	0.45
53	000792	盐湖股份	23,765.00	501,441.50	0.44
54	600015	华夏银行	49,995.00	494,450.55	0.44
55	300070	碧水源	33,107.00	492,632.16	0.43
56	600031	三一重工	96,846.00	486,166.92	0.43
57	000750	国海证券	64,627.00	477,593.53	0.42
58	601111	中国国航	69,731.00	471,381.56	0.42
59	000776	广发证券	27,912.00	467,805.12	0.41
60	600028	中国石化	98,236.00	463,673.92	0.41
61	300104	乐视网	8,700.00	460,317.00	0.41
62	600999	招商证券	27,174.00	448,371.00	0.40
63	300059	东方财富	20,040.00	444,888.00	0.39
64	600518	康美药业	29,226.00	443,942.94	0.39
65	600221	海南航空	135,674.00	430,086.58	0.38
66	600867	通化东宝	20,296.00	419,924.24	0.37
67	600958	东方证券	24,700.00	415,207.00	0.37
68	002450	康得新	24,214.00	414,059.40	0.37
69	600023	浙能电力	80,312.00	408,788.08	0.36
70	300058	蓝色光标	42,039.00	408,198.69	0.36
71	600011	华能国际	53,867.00	405,079.84	0.36
72	002304	洋河股份	5,624.00	404,478.08	0.36
73	002736	国信证券	22,900.00	395,025.00	0.35
74	000963	华东医药	5,776.00	389,302.40	0.34
75	002024	苏宁云商	34,975.00	379,828.50	0.33
76	600705	中航资本	62,988.00	370,369.44	0.33
77	002415	海康威视	17,249.00	370,163.54	0.33
78	600688	上海石化	60,572.00	369,489.20	0.33
79	300003	乐普医疗	20,200.00	368,448.00	0.32
80	601390	中国中铁	52,401.00	365,234.97	0.32
81	000778	新兴铸管	78,238.00	363,024.32	0.32
82	000783	长江证券	31,197.00	361,885.20	0.32
83	601006	大秦铁路	55,514.00	357,510.16	0.32
84	002739	万达院线	4,400.00	351,560.00	0.31

85	000166	申万宏源	41,775.00	351,327.75	0.31
86	000425	徐工机械	113,606.00	347,634.36	0.31
87	002673	西部证券	13,122.00	339,334.92	0.30
88	601857	中国石油	46,049.00	332,934.27	0.29
89	600188	兖州煤业	30,062.00	328,878.28	0.29
90	601628	中国人寿	15,775.00	328,435.50	0.29
91	601009	南京银行	34,564.00	324,555.96	0.29
92	601186	中国铁建	32,389.00	322,594.44	0.28
93	601333	广深铁路	81,938.00	320,377.58	0.28
94	601336	新华保险	7,877.00	318,230.80	0.28
95	000063	中兴通讯	22,186.00	318,147.24	0.28
96	000538	云南白药	4,865.00	312,819.50	0.28
97	600570	恒生电子	4,619.00	308,410.63	0.27
98	601958	金钼股份	37,430.00	305,054.50	0.27
99	600050	中国联通	79,008.00	301,020.48	0.27
100	600637	东方明珠	12,389.00	300,681.03	0.27
101	300017	网宿科技	4,473.00	300,585.60	0.26
102	601985	中国核电	43,900.00	299,837.00	0.26
103	601899	紫金矿业	88,527.00	298,335.99	0.26
104	000625	长安汽车	21,253.00	290,528.51	0.26
105	002422	科伦药业	18,708.00	288,290.28	0.25
106	002230	科大讯飞	8,486.00	278,765.10	0.25
107	002385	大北农	34,529.00	278,303.74	0.25
108	002410	广联达	19,300.00	275,990.00	0.24
109	600998	九州通	15,678.00	274,521.78	0.24
110	600111	北方稀土	20,458.00	272,295.98	0.24
111	600585	海螺水泥	18,713.00	272,087.02	0.24
112	000503	海虹控股	6,758.00	271,739.18	0.24
113	601555	东吴证券	19,816.00	265,534.40	0.23
114	601099	太平洋	43,200.00	264,816.00	0.23
115	600153	建发股份	21,951.00	263,412.00	0.23
116	600010	包钢股份	91,452.00	261,552.72	0.23
117	300024	机器人	10,264.00	260,602.96	0.23
118	601088	中国神华	18,504.00	260,351.28	0.23
119	000423	东阿阿胶	4,919.00	259,870.77	0.23
120	601211	国泰君安	14,500.00	257,955.00	0.23
121	600690	青岛海尔	28,742.00	255,228.96	0.23
122	600066	宇通客车	12,657.00	250,608.60	0.22
123	600271	航天信息	10,430.00	248,234.00	0.22
124	600893	中航动力	7,160.00	248,094.00	0.22
125	002241	歌尔股份	8,647.00	247,995.96	0.22
126	300027	华谊兄弟	18,284.00	247,565.36	0.22

127	600009	上海机场	9,221.00	240,207.05	0.21
128	600703	三安光电	11,986.00	239,360.42	0.21
129	002294	信立泰	8,650.00	235,280.00	0.21
130	600029	南方航空	32,806.00	231,610.36	0.20
131	601198	东兴证券	9,400.00	229,736.00	0.20
132	600019	宝钢股份	46,620.00	228,438.00	0.20
133	000100	TCL 集团	68,889.00	226,644.81	0.20
134	002202	金风科技	14,642.00	221,533.46	0.20
135	601669	中国电建	38,651.00	220,697.21	0.19
136	000839	中信国安	10,300.00	219,493.00	0.19
137	600535	天士力	6,061.00	216,741.36	0.19
138	600027	华电国际	43,318.00	214,424.10	0.19
139	600115	东方航空	31,940.00	211,123.40	0.19
140	601727	上海电气	27,891.00	210,855.96	0.19
141	601168	西部矿业	30,800.00	210,672.00	0.19
142	600196	复星医药	10,945.00	208,173.90	0.18
143	600089	特变电工	24,410.00	207,973.20	0.18
144	000009	中国宝安	14,915.00	204,335.50	0.18
145	601888	中国国旅	4,593.00	202,000.14	0.18
146	000768	中航飞机	10,254.00	201,901.26	0.18
147	600177	雅戈尔	14,639.00	201,871.81	0.18
148	002456	欧菲光	6,831.00	201,514.50	0.18
149	600649	城投控股	13,991.00	200,910.76	0.18
150	002465	海格通信	16,096.00	200,234.24	0.18
151	002252	上海莱士	5,280.00	198,950.40	0.18
152	000069	华侨城 A	31,001.00	198,406.40	0.17
153	601607	上海医药	10,973.00	198,062.65	0.17
154	000568	泸州老窖	6,635.00	197,059.50	0.17
155	600485	信威集团	10,956.00	195,455.04	0.17
156	600804	鹏博士	10,643.00	194,021.89	0.17
157	601600	中国铝业	51,210.00	193,061.70	0.17
158	600369	西南证券	26,460.00	192,099.60	0.17
159	601788	光大证券	11,200.00	189,728.00	0.17
160	600660	福耀玻璃	13,406.00	187,684.00	0.17
161	600118	中国卫星	5,563.00	186,916.80	0.16
162	000728	国元证券	11,157.00	186,545.04	0.16
163	600406	国电南瑞	13,891.00	185,722.67	0.16
164	000937	冀中能源	34,800.00	185,136.00	0.16
165	600352	浙江龙盛	21,430.00	184,726.60	0.16
166	600489	中金黄金	16,339.00	183,650.36	0.16
167	002008	大族激光	8,015.00	183,062.60	0.16
168	601919	中国远洋	35,900.00	182,372.00	0.16
169	600208	新湖中宝	42,861.00	181,302.03	0.16

170	601018	宁波港	36,247.00	179,422.65	0.16
171	002236	大华股份	13,653.00	178,854.30	0.16
172	000338	潍柴动力	22,690.00	177,208.90	0.16
173	002500	山西证券	10,674.00	176,761.44	0.16
174	600309	万华化学	10,170.00	175,941.00	0.16
175	000917	电广传媒	10,597.00	175,168.41	0.15
176	002475	立讯精密	8,902.00	174,924.30	0.15
177	300124	汇川技术	8,959.00	173,804.60	0.15
178	600674	川投能源	20,804.00	171,841.04	0.15
179	000559	万向钱潮	11,007.00	171,709.20	0.15
180	600718	东软集团	9,289.00	170,174.48	0.15
181	000157	中联重科	41,061.00	169,581.93	0.15
182	000623	吉林敖东	6,794.00	169,510.30	0.15
183	002183	怡亚通	11,800.00	168,976.00	0.15
184	600446	金证股份	4,700.00	168,965.00	0.15
185	601618	中国中冶	45,693.00	168,607.17	0.15
186	000400	许继电气	10,800.00	166,752.00	0.15
187	600741	华域汽车	11,871.00	166,312.71	0.15
188	000540	中天城投	26,400.00	164,472.00	0.14
189	000876	新希望	19,766.00	164,453.12	0.14
190	601998	中信银行	28,837.00	163,505.79	0.14
191	000630	铜陵有色	62,830.00	159,588.20	0.14
192	600415	小商品城	25,558.00	157,948.44	0.14
193	601933	永辉超市	38,130.00	157,476.90	0.14
194	600663	陆家嘴	6,847.00	155,769.25	0.14
195	600018	上港集团	30,538.00	155,743.80	0.14
196	601800	中国交建	14,593.00	153,664.29	0.14
197	600085	同仁堂	5,131.00	152,852.49	0.13
198	603993	洛阳钼业	36,720.00	152,388.00	0.13
199	000060	中金岭南	14,533.00	151,579.19	0.13
200	600068	葛洲坝	25,967.00	151,127.94	0.13
201	002065	东华软件	8,060.00	150,883.20	0.13
202	002081	金螳螂	14,916.00	149,458.32	0.13
203	000046	泛海控股	14,700.00	148,617.00	0.13
204	000826	启迪桑德	4,826.00	147,434.30	0.13
205	002292	奥飞娱乐	4,916.00	147,234.20	0.13
206	600398	海澜之家	12,915.00	145,939.50	0.13
207	600583	海油工程	20,835.00	143,969.85	0.13
208	600150	中国船舶	6,374.00	141,885.24	0.13
209	600816	安信信托	8,300.00	140,021.00	0.12
210	300144	宋城演艺	5,600.00	139,496.00	0.12
211	300015	爱尔眼科	3,811.00	139,215.83	0.12
212	002007	华兰生物	4,404.00	138,285.60	0.12

213	600157	永泰能源	35,094.00	138,270.36	0.12
214	000402	金融街	14,025.00	136,323.00	0.12
215	600588	用友网络	6,902.00	135,141.16	0.12
216	600060	海信电器	7,566.00	133,766.88	0.12
217	600895	张江高科	7,300.00	131,984.00	0.12
218	000977	浪潮信息	5,600.00	131,320.00	0.12
219	601106	中国一重	24,700.00	128,687.00	0.11
220	600074	保千里	8,513.00	127,013.96	0.11
221	600332	白云山	5,115.00	126,033.60	0.11
222	600820	隧道股份	14,800.00	124,172.00	0.11
223	601098	中南传媒	6,854.00	124,125.94	0.11
224	000415	渤海金控	18,100.00	123,442.00	0.11
225	600642	申能股份	21,426.00	122,985.24	0.11
226	600256	广汇能源	29,354.00	120,351.40	0.11
227	300002	神州泰岳	11,200.00	119,168.00	0.11
228	002470	金正大	14,800.00	119,140.00	0.11
229	601866	中海集运	29,827.00	118,114.92	0.10
230	601258	庞大集团	42,608.00	117,172.00	0.10
231	600376	首开股份	10,500.00	116,760.00	0.10
232	000738	中航动控	4,400.00	116,160.00	0.10
233	600252	中恒集团	26,078.00	113,178.52	0.10
234	002129	中环股份	13,652.00	113,175.08	0.10
235	601718	际华集团	14,699.00	112,300.36	0.10
236	600875	东方电气	11,314.00	111,103.48	0.10
237	600737	中粮屯河	9,600.00	110,880.00	0.10
238	601021	春秋航空	2,300.00	110,262.00	0.10
239	000709	河钢股份	39,648.00	109,824.96	0.10
240	600873	梅花生物	17,628.00	109,469.88	0.10
241	601991	大唐发电	28,100.00	109,309.00	0.10
242	600373	中文传媒	5,172.00	107,319.00	0.09
243	300133	华策影视	6,794.00	105,782.58	0.09
244	600362	江西铜业	7,778.00	104,847.44	0.09
245	600005	武钢股份	37,800.00	104,328.00	0.09
246	601117	中国化学	18,465.00	102,111.45	0.09
247	000729	燕京啤酒	13,396.00	101,675.64	0.09
248	600704	物产中大	10,790.00	100,994.40	0.09
249	000039	中集集团	7,062.00	100,068.54	0.09
250	000061	农产品	8,176.00	99,420.16	0.09
251	600037	歌华有线	6,500.00	98,865.00	0.09
252	000629	*ST 钒钛	41,301.00	98,709.39	0.09
253	601179	中国西电	19,441.00	98,565.87	0.09
254	600372	中航电子	5,020.00	97,739.40	0.09
255	601225	陕西煤业	18,730.00	96,834.10	0.09

256	002027	分众传媒	5,800.00	95,758.00	0.08
257	601633	长城汽车	11,304.00	95,405.76	0.08
258	601872	招商轮船	20,000.00	93,600.00	0.08
259	300146	汤臣倍健	6,846.00	92,694.84	0.08
260	600038	中直股份	2,199.00	91,214.52	0.08
261	603779	威龙股份	2,157.00	90,507.72	0.08
262	000999	华润三九	3,718.00	90,049.96	0.08
263	601216	君正集团	11,892.00	88,833.24	0.08
264	002195	二三四五	7,203.00	88,524.87	0.08
265	601898	中煤能源	17,123.00	88,354.68	0.08
266	603000	人民网	5,314.00	88,265.54	0.08
267	600008	首创股份	22,634.00	88,046.26	0.08
268	600827	百联股份	7,275.00	87,882.00	0.08
269	000712	锦龙股份	4,200.00	87,192.00	0.08
270	000883	湖北能源	18,374.00	85,071.62	0.07
271	600021	上海电力	8,200.00	84,214.00	0.07
272	000800	一汽轿车	7,701.00	83,786.88	0.07
273	002146	荣盛发展	12,360.00	83,059.20	0.07
274	600863	内蒙华电	27,163.00	82,032.26	0.07
275	002153	石基信息	2,994.00	78,981.72	0.07
276	600959	江苏有线	5,600.00	78,176.00	0.07
277	300085	银之杰	2,600.00	77,740.00	0.07
278	600600	青岛啤酒	2,656.00	77,209.92	0.07
279	601928	凤凰传媒	7,259.00	76,509.86	0.07
280	600666	奥瑞德	2,200.00	76,472.00	0.07
281	000156	华数传媒	3,978.00	73,791.90	0.07
282	600648	外高桥	3,715.00	73,222.65	0.06
283	002798	帝王洁具	844.00	73,174.80	0.06
284	000027	深圳能源	11,211.00	71,526.18	0.06
285	601808	中海油服	5,785.00	70,287.75	0.06
286	600582	天地科技	15,500.00	69,750.00	0.06
287	002424	贵州百灵	4,000.00	68,800.00	0.06
288	603737	三棵树	592.00	68,719.36	0.06
289	300516	久之洋	392.00	68,666.64	0.06
290	000825	太钢不锈	21,687.00	68,530.92	0.06
291	000898	鞍钢股份	17,342.00	66,419.86	0.06
292	600871	石化油服	16,900.00	64,896.00	0.06
293	601611	中国核建	3,075.00	64,329.00	0.06
294	601608	中信重工	11,600.00	62,292.00	0.05
295	601118	海南橡胶	11,135.00	62,244.65	0.05
296	600317	营口港	18,300.00	61,488.00	0.05
297	600783	鲁信创投	2,826.00	61,069.86	0.05
298	002399	海普瑞	3,496.00	61,040.16	0.05

299	600098	广州发展	7,700.00	60,214.00	0.05
300	600578	京能电力	13,972.00	59,800.16	0.05
301	600685	中船防务	2,300.00	58,328.00	0.05
302	603131	上海沪工	884.00	53,658.80	0.05
303	300515	三德科技	1,129.00	52,916.23	0.05
304	603919	金徽酒	1,509.00	46,628.10	0.04
305	601127	小康股份	1,589.00	37,929.43	0.03
306	002799	环球印务	864.00	37,704.96	0.03
307	600022	山东钢铁	15,800.00	37,446.00	0.03
308	002568	百润股份	1,700.00	37,400.00	0.03
309	600606	绿地控股	3,400.00	36,788.00	0.03
310	603885	吉祥航空	1,400.00	36,750.00	0.03
311	300518	盛讯达	453.00	21,223.05	0.02
312	601016	节能风电	2,000.00	19,860.00	0.02
313	002802	洪汇新材	1,126.00	16,980.08	0.01
314	603909	合诚股份	759.00	13,950.42	0.01
315	603958	哈森股份	865.00	12,542.50	0.01
316	603016	新宏泰	912.00	7,742.88	0.01
317	300520	科大国创	718.00	7,215.90	0.01
318	002805	丰元股份	971.00	5,631.80	0.00

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 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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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－东方汇智一道冲基石 1 号资产管理计	6,676,831.00	26.93%
2	东方汇智资管－招商银行－东方汇智一道冲基石 2 号资产管理计	3,922,384.00	15.82%
3	福建道冲投资管理有 限公司－道冲量化 2 号	3,124,032.00	12.60%
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、基金投资和研究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	
		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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	报告期内基金管理人对手指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间进行公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2016-01-06
2	报告期内基金管理人对本基金持有的海格通信进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-01-15
3	报告期内基金管理人对本基金持有的宁波港进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-01-15
4	报告期内基金管理人对手国投瑞银网上直销转账汇款买基金认、申购费率优惠进行公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-01-28
5	报告期内基金管理人对手本基金持有的康得新进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-01-29
6	报告期内基金管理人对手本基金持有的梅花生物进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-01-29
7	报告期内基金管理人对手基金行业高级管理人员变更情况进行公告	证券时报	2016-02-05
8	报告期内基金管理人对手本基金持有的信威集团进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-02-17
9	报告期内基金管理人对手本基金持有的浦发银行行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-02-23
10	报告期内基金管理人对手本基金持有的格力电器进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-03-01
11	报告期内基金管理人对手本基金持有的西部矿业进行估值调整	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-03-08
12	报告期内基金管理人对手董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况进行公告	证券时报	2016-03-23
13	报告期内基金管理人对手淘宝店关闭申购类服务进行公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-05-05
14	报告期内基金管理人对手网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务进行公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016-05-05
15	报告期内基金管理人对手从业人员在子公司兼职情况进行公告	证券时报	2016-05-31

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

《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》（证监许可[2009]865 号）

《关于国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2009]666 号）

《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》

《国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》

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

国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告原文

11.2 存放地点

深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日