

2012年10月25日 星期四

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2012年09月30日

[2012] 第三季度报告

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:2012年10月25日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银沪深300指数分级

基金主代码 161207

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2009年10月14日

报告期末基金份额总额 886,557,685.14份

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，力求将基金单位净值增长率与业绩比较基准之间的平均跟踪误差控制在3.5%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本权重构建股票组合，并根据其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。

当因特殊情况(如股权重置改革等)导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。

业绩比较基准 95%×沪深300指数收益率+5%×银行同期存款利率

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。

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

下属分级基金的基金简称 国投瑞银瑞和沪深300指数

下属分级基金的交易代码 161207 150008

报告期末下属分级基金的份额总额 449,770,287.14份

218,393,699.00份

218,393,699.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2012年07月01日-2012年09月30日)

1.本期已实现收益 -63,261,211.80

2.本期利润 -53,250,264.84

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0589

4.期末基金份额净值 0.880

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日常费用后的余额，本期利润为利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣除日常费用和申购赎回费用后的余额，本期利润与本期已实现收益之差即为期间利息收入。2.以上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用（例如基金申购赎回费、基金转换费等），费用影响会导致实际业绩与排名结果存在差异。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.2 自基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

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.3 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.4 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.5 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.6 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.7 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.8 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.9 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.10 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.11 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.12 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.13 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.14 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.15 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -6.38% 1.14% -6.49% 1.13% 0.11% 0.01%

注:1.本基金是以人民币为计价货币的开放式基金，对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不超过基金资产净值的50%，并保持不低于50%的现金或到期日不超过一年的政府债券占基金净值比例4%以上。

2.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

3.2.16 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -0.00% 0.09% -1.88% 0.12% 1.88% -0.03%

注:1.本基金以可转债、信用债为主要投资品种，强调基金资产的稳定性。本基金以中信标普转债指数、中债全价指数为基准指标，按中信标普转债指数×45%+中债国债指数×55%的比例构建投资组合。

2.本基金的业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用（例如基金申购赎回费、基金转换费等），费用影响会导致实际业绩与排名结果存在差异。

3.2.17 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 累计增长 业绩比较基准 收益率比较基准 差①-③ ②-④

过去三个月 -0.00% 0.09% -1.88% 0.12% 1.88% -0.03%

注:1.本基金以可转债、信用债为主要投资品种，强调基金资产的稳定性。本基金以中信标普转债指数、中债全价指数为基准指标，按中信标普转债指数×45%+中债国债指数×55%的比例构建投资组合。