

Table with columns: 基金代码, 基金名称, 成功认购, 可流通, 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

8.4.9.2 期末持有的暂时停牌或流通受限股票金额单位:人民币元

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 停牌原因, 期末估值单价, 数量, 期末成本总额, 期末估值总额

注:本基金截至2012年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在该事项重大影响的期限内持续停牌,交易所批准复牌后,本基金将按照交易所复牌公告日期进行交易

8.4.9.3 银行间市场债券正回购
本基金期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券

8.4.9.4 交易所市场债券正回购
本基金期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券

8.4.10 有助于解释和分析会计报表的重要事项
a) 公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差不多

b) 以公允价值计量的金融工具
d) 公允价值计量的方法
根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价
第二层级:直接(如报价)或间接(如根据价格推算的)可观察到的,除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值
第三层级:以不可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)

g) 各层级金融工具公允价值
于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为6,423,154,851.08元,属于第二层级的余额为867,259,268.8元,属于第三层级的余额-

h) 公允价值所属层级间的重要变动
本基金在本期公允价值所属层级间的重要变动情况如下:
1. 买入返售金融资产: 895,001,805.50
2. 应收利息: 1,800,132,889.22
3. 其他流动资产: 577,575.37

9. 年度财务报表(国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金)
9.1 资产负债表
单位:人民币元

Balance Sheet table with columns: 资产, 附注号, 2012年07月16日, 2011年12月31日

9.2 利润表
单位:人民币元

Income Statement table with columns: 项目, 附注号, 2012年01月01日至2012年07月16日, 2011年01月01日至2011年12月31日

9.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Equity Statement table with columns: 项目, 2012年01月01日至2012年07月16日, 2011年01月01日至2011年12月31日

9.4 报表附注
9.4.1 基金基本情况
国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会基金部备案(以下简称“国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金”)于2007年11月18日获准设立,由国投瑞银基金管理有限责任公司(以下简称“国投瑞银”)担任基金管理人,由国投瑞银基金管理有限责任公司(以下简称“国投瑞银”)担任基金托管人

9.4.2 基金主要会计政策和会计估计
本基金的财务报表按照财政部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、应用指南和企业会计准则解释的有关规定编制

9.4.3 基金估值
本基金的估值按照《证券投资基金估值业务指导意见》(证监会公告[2002]21号)及《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2005]4号)的有关规定进行

9.4.4 基金费用
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付

9.4.5 基金收益分配
本基金收益分配方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或红利再投资

9.4.6 基金税收
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[2005]102号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利所得及其他投资收益征收个人所得税的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税收法规和实务操作,本基金主要会计政策和会计估计如下:

9.4.7 关联方关系
关联方名称: 国投瑞银基金管理有限公司
基金管理人、瑞福收到申购赎回基金份额机构
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
国投信托有限公司
基金管理人、基金托管人、基金销售机构的股东
瑞福证券投资基金
基金管理人、基金托管人、基金销售机构的股东

9.4.8 关联交易
本基金本报告期及上年度可比期间的关联方交易
9.4.8.1 通过关联方交易
本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易买卖证券的行为
9.4.8.2 关联方担保
本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方担保的行为

9.4.9 期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金总资产的比例(%)

10.2.2 积极投资部分
10.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
10.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

仍以持续经营假设编制基础
9.4.3 遵循基金会计准则及其他相关规定的说明
本基金2012年1月1日至2012年7月16日 基金合同生效前日 止期间的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2012年7月16日 基金合同生效前日 的财务状况以及2012年1月1日至2012年7月16日 基金合同生效前日 期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息

9.4.4 本报告期末采用的会计政策、会计估计与上年度可比期间一致
9.4.5 会计差错更正的说明
本基金本报告期无会计差错更正

9.4.6 关联方关系
关联方名称: 国投瑞银基金管理有限公司
基金管理人、瑞福收到申购赎回基金份额机构
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
国投信托有限公司
基金管理人、基金托管人、基金销售机构的股东
瑞福证券投资基金
基金管理人、基金托管人、基金销售机构的股东

9.4.7 关联交易
9.4.7.1 通过关联方交易
9.4.7.2 关联方担保

9.4.8 期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上年度可比期间

9.4.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

10.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
金额单位:人民币元

10.8 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
金额单位:人民币元

10.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.82 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.90 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.91 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.93 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.97 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.100 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.101 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.102 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.103 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.105 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.106 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.107 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.108 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.109 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.110 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.111 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.112 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.113 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.114 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.115 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.116 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.117 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.118 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.119 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.120 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.121 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.122 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.123 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.124 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

10.9.125 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元