

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2012年度报告摘要

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
报告日期:2013年3月27日

本报告摘要节选自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应当仔细阅读年度报告正文。
本报告自2012年1月1日起至12月31日止。

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构均承诺不存在虚假记载、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法律责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证收益最低水平。

本报告摘要节选自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应当仔细阅读年度报告正文。
本报告自2012年1月1日起至12月31日止。

1.2 基金基本情况
基金名称:国投瑞银沪深300指数分级证券投资基金
基金代码:161207
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012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

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。
8.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票投资

Table with columns: 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(%)

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。
8.4 买入股票的成本(成交金额)

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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。
8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资

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(%)

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。
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资

Table with columns: 序号, 名称, 金额

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。
8.7 期末持有的流通受限股票

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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。
8.8 期末持有的流通受限债券

Table with columns: 序号, 名称, 金额

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。
8.9 期末持有的流通受限资产

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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。
8.10 期末持有的流通受限资产

Table with columns: 序号, 名称, 金额

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。
8.11 期末持有的流通受限资产

Table with columns: 序号, 名称, 金额

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。
8.12 期末持有的流通受限资产

Table with columns: 项目, 本期, 上期

注:截至本报告期末各项资产分配比例符合股票资产基金净值比例94.67%,权证资产占净值比例0.0%,债券资产占净值比例3.88%,现金和到期日为1年以内的政府债券占净值比例1.38%,符合基金合同的相关规定。
3.2.3 本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:截至本报告期末各项资产分配比例符合股票资产基金净值比例94.67%,权证资产占净值比例0.0%,债券资产占净值比例3.88%,现金和到期日为1年以内的政府债券占净值比例1.38%,符合基金合同的相关规定。
3.2.3 本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较