

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：2013年4月22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。

基金托管人对中国工商银行股份有限公司根据《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金管理合同》的约定，于2013年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告书中的财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

报告日期：2013年1月1日至3月31日

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年01月01日-2013年03月31日)

1.本期已实现收益 4,926,191.04

2.本期利润 -35,205,251.23

3.期末平均基金份额本期利润 -0.0048

4.期末基金资产净值 99,456.31

5.期末基金份额净值 0.992

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、股权投资收益、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.以上所列各项金额比例为分别为基金投资占基金净值比例49.59%，权证投资占基金净值比例0.02%，货币市场基金投资占基金净值比例2.07%，现金和到期后不超过1年的政府债券占基金净值比例5.51%，其他资产占基金净值的比例为0.01%。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.截至本报告期末各项资产配置比例分别为股票投资占基金净值比例49.59%，权证投资占基金净值比例0.02%，货币市场基金投资占基金净值比例2.07%，现金和到期后不超过1年的政府债券占基金净值比例5.51%，其他资产占基金净值的比例为0.01%。

2.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

阶段 净值增长 累计净值 增长率(%) 基准收益率(%) 收益差(%) ①-② ②-④ ③-④

过去三个月 -0.42% 1.43% 0.28% 1.40% -0.70% 0.03%

注：1.由于本基金的标的指数为深证100指数成分股及备选股，因此基金业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

2.本基金业绩基准的计算方法：(1-深证100指数成分股及备选股占基金净值比例)×95%×深证100价格指数收益率+5%×银行存款利率(税后)。

3.本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

</