

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
送出日期:2015年8月28日

国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金

2015 半年度报告摘要

1.1 重要提示
1.2 基金简介
2.1 基金基本情况

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况声明

估值业务的指导原则,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值方法进行估值。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金简称, 基金管理人, 基金托管人, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人地址, 基金托管人地址, 基金销售机构, 基金管理人网址, 基金托管人网址, 基金客服电话, 基金传真

2.2 基金产品说明
2.3 基金管理人及基金托管人
2.4 信息披露方式

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守法律、行政法规、部门规章及基金合同的情况的说明
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

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
6.4.5.2 会计估计变更的说明

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
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

6.1 资产负债表
6.2 利润表

6.4.6 税项
6.4.7 关联方关系
6.4.8.1 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

Table with 2 columns: 项目, 本报告期末/本报告期末比上年末增减

Table with 2 columns: 资产, 期末余额, 年初余额

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.9 期末可供出售金融资产公允价值变动损益的说明

4 基金管理人及基金基金经理情况
4.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.1 因认购未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.2 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

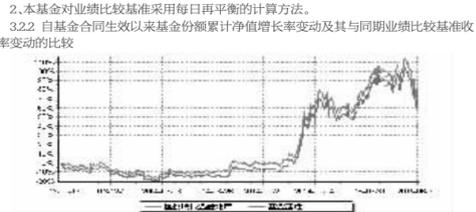


Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.3 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.4 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2 基金业绩 (或基金基金经理小组) 及基金基金经理简介
4.2.1 基金业绩

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.5 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.6 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2 基金基金经理 (或基金基金经理小组) 及基金基金经理简介
4.2.2.1 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.7 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.8 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2.2 基金基金经理
4.2.2.3 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.9 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.10 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2.4 基金基金经理
4.2.2.5 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.11 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.12 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2.6 基金基金经理
4.2.2.7 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.13 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.14 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2.8 基金基金经理
4.2.2.9 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.15 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.16 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2.10 基金基金经理
4.2.2.11 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.17 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.18 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

4.2.2.12 基金基金经理
4.2.2.13 基金基金经理

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 年初余额

6.4.9.19 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.20 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期末总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占期末总资产比例

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表
6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.9 期末可供出售金融资产公允价值变动损益的说明

6.4.2 会计报表的编制基础
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

6.4.9.21 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.22 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.4 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.9.23 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.24 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.6 税项
6.4.7 关联方关系

6.4.9.25 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.26 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.8 关联方关系
6.4.8.1 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

6.4.9.27 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.28 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.9 期末可供出售金融资产公允价值变动损益的说明

6.4.9.29 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.30 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.9 期末可供出售金融资产公允价值变动损益的说明
6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.9.31 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.32 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.11 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.12 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.9.33 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.34 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.13 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
6.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.35 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.36 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.15 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.16 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.37 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.38 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.17 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.18 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.39 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.40 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.19 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.20 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.41 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.42 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.21 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.22 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.43 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.44 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.23 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.24 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.45 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.46 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.25 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.26 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.47 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.48 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

6.4.27 其他重要的会计政策和会计估计
6.4.28 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.9.49 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券
6.4.9.50 期末未发行/增发证券而未持有的流通受限证券

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净值2%或前20名的股票明细

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 卖出金额, 占期末总资产比例

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

Table with 2 columns: 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额

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

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

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

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

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

7.10 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.11.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.12 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.12.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.12.2 本基金投资期权的投资政策

7.13 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.13.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.13.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.14 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.14.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.14.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.15 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.15.1 本报告期末本基金投资的权证持仓持仓损益明细

7.15.2 本基金投资权证的投资政策

7.16 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.16.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.16.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.17 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.17.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.17.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.18 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.18.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.18.2 本基金投资期权的投资政策

7.19 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.19.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.19.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.20 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.20.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.20.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.21 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.21.1 本报告期末本基金投资的权证持仓持仓损益明细

7.21.2 本基金投资权证的投资政策

7.22 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.22.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.22.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.23 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.23.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.23.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.24 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.24.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.24.2 本基金投资期权的投资政策

7.25 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.25.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.25.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.26 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.26.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.26.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.27 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.27.1 本报告期末本基金投资的权证持仓持仓损益明细

7.27.2 本基金投资权证的投资政策

7.28 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.28.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.28.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.29 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.29.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.29.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.30 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.30.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.30.2 本基金投资期权的投资政策

7.31 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.31.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.31.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.32 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.32.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.32.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.33 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.33.1 本报告期末本基金投资的权证持仓持仓损益明细

7.33.2 本基金投资权证的投资政策

7.34 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.34.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.34.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.35 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.35.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.35.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.36 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.36.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.36.2 本基金投资期权的投资政策

7.37 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.37.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.37.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.38 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.38.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.38.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.39 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.39.1 本报告期末本基金投资的权证持仓持仓损益明细

7.39.2 本基金投资权证的投资政策

7.40 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.40.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.40.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.41 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.41.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.41.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.42 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.42.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.42.2 本基金投资期权的投资政策

7.43 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.43.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.43.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.44 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.44.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.44.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.45 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.45.1 本报告期末本基金投资的权证持仓持仓损益明细

7.45.2 本基金投资权证的投资政策

7.46 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.46.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓持仓损益明细

7.46.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.47 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.47.1 本报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓损益明细

7.47.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.48 本报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.48.1 本报告期末本基金投资的期权持仓持仓损益明细

7.48.2 本基金投资期权的投资政策

7.49 本报告期末本基金投资的资产支持证券交易情况说明

7.49.1 本报告期末本基金投资的资产支持证券持仓持仓损益明细

7.49.2 本基金投资资产支持证券的投资政策

7.50 本报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明

7.50.1 本报告期末本基金投资的贵金属持仓持仓损益明细

7.50.2 本基金投资贵金属的投资政策

7.51 本报告期末本基金投资的权证交易情况说明

7.51.1