

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

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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。
基金管理人及基金托管人承诺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。

2.1 基金基本情况
基金简称: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联接基金
基金代码:161211
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2015年4月9日

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金通过主要投资于目标ETF基金份额,力争实现与目标ETF基金相似的长期投资回报。
投资策略:本基金资产配置策略:本基金主要投资于目标ETF基金份额,力争实现与目标ETF基金相似的长期投资回报。

2.3 基金业绩比较基准
业绩比较基准:沪深300金融地产指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)
风险收益特征:本基金为股票型基金,属于中高风险收益的投资品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.4 基金管理人、基金托管人
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
基金管理人地址:深圳市福田区金田路4028号安联大厦34层
基金托管人地址:中国工商银行股份有限公司

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要会计数据和财务指标
3.1.2 基金净值表现
3.1.3 基金业绩比较基准

3.2 基金投资组合报告
3.2.1 基金资产配置情况
3.2.2 基金持仓情况
3.2.3 基金业绩比较基准

3.3 基金管理人、基金托管人
3.3.1 基金管理人
3.3.2 基金托管人

3.4 基金管理人、基金托管人
3.4.1 基金管理人
3.4.2 基金托管人

3.5 基金管理人、基金托管人
3.5.1 基金管理人
3.5.2 基金托管人

3.6 基金管理人、基金托管人
3.6.1 基金管理人
3.6.2 基金托管人

3.7 基金管理人、基金托管人
3.7.1 基金管理人
3.7.2 基金托管人

3.8 基金管理人、基金托管人
3.8.1 基金管理人
3.8.2 基金托管人

3.9 基金管理人、基金托管人
3.9.1 基金管理人
3.9.2 基金托管人

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联接基金

2015 半年度报告摘要

本基金的财务报表按照财政部于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,以及其他相关规定进行编制。
本基金的财务报表按照财政部于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,以及其他相关规定进行编制。

4.1 基金管理人、基金托管人
4.1.1 基金管理人
4.1.2 基金托管人

4.2 基金管理人、基金托管人
4.2.1 基金管理人
4.2.2 基金托管人

4.3 基金管理人、基金托管人
4.3.1 基金管理人
4.3.2 基金托管人

4.4 基金管理人、基金托管人
4.4.1 基金管理人
4.4.2 基金托管人

4.5 基金管理人、基金托管人
4.5.1 基金管理人
4.5.2 基金托管人

4.6 基金管理人、基金托管人
4.6.1 基金管理人
4.6.2 基金托管人

4.7 基金管理人、基金托管人
4.7.1 基金管理人
4.7.2 基金托管人

4.8 基金管理人、基金托管人
4.8.1 基金管理人
4.8.2 基金托管人

4.9 基金管理人、基金托管人
4.9.1 基金管理人
4.9.2 基金托管人

4.10 基金管理人、基金托管人
4.10.1 基金管理人
4.10.2 基金托管人

4.11 基金管理人、基金托管人
4.11.1 基金管理人
4.11.2 基金托管人

4.12 基金管理人、基金托管人
4.12.1 基金管理人
4.12.2 基金托管人

4.13 基金管理人、基金托管人
4.13.1 基金管理人
4.13.2 基金托管人

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

7.1 买入股票二级市场上市主动买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票, 不包括本基金申购的ETF基金份额导致的基金组合中股票的减少。
7.2 买入股票 按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

Table with 5 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(%)

7.3 卖出主要指二级市场上市主动地卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票, 不包括因本基金申购的ETF基金份额导致的基金组合中股票的减少。
7.4 卖出股票 按卖出成交金额(成交单乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

7.5 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
7.6 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 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融投资明细
7.9 报告期末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 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
7.11.2 本基金股指期货投资情况说明

7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
7.12.1 本基金国债期货投资情况说明
7.12.2 本基金国债期货投资情况说明

7.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
7.13.1 本基金国债期货投资情况说明
7.13.2 本基金国债期货投资情况说明

7.14 报告期末处于转股期的可转换债券持仓和损益明细
7.14.1 报告期末处于转股期的可转换债券持仓和损益明细
7.14.2 报告期末处于转股期的可转换债券持仓和损益明细

7.15 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
7.15.1 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
7.15.2 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

7.16 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
7.16.1 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
7.16.2 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

6.1 资产负债表
会计主体: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联接基金
报告截止日:2015年6月30日

Table with 3 columns: 资产, 负债, 所有者权益

6.2 利润表
会计主体: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联接基金
报告截止日:2015年6月30日

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体: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联接基金
报告截止日:2015年6月30日

Table with 3 columns: 姓名, 附号, 本期, 上期

6.4 投资组合报告
6.4.1 基金资产配置情况
6.4.2 基金持仓情况
6.4.3 基金业绩比较基准

6.4.4 基金管理人、基金托管人
6.4.4.1 基金管理人
6.4.4.2 基金托管人

6.4.5 基金管理人、基金托管人
6.4.5.1 基金管理人
6.4.5.2 基金托管人

6.4.6 基金管理人、基金托管人
6.4.6.1 基金管理人
6.4.6.2 基金托管人

6.4.7 基金管理人、基金托管人
6.4.7.1 基金管理人
6.4.7.2 基金托管人

6.4.8 基金管理人、基金托管人
6.4.8.1 基金管理人
6.4.8.2 基金托管人

6.4.9 基金管理人、基金托管人
6.4.9.1 基金管理人
6.4.9.2 基金托管人

注:1、买入股票二级市场上市主动买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票, 不包括本基金申购的ETF基金份额导致的基金组合中股票的减少。

注:2、买入股票 按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

注:3、卖出主要指二级市场上市主动地卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票, 不包括因本基金申购的ETF基金份额导致的基金组合中股票的减少。

注:4、卖出股票 按卖出成交金额(成交单乘以成交数量)填列, 不考虑相关交易费用。

注:5、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
注: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

注: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
注:8、报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融投资明细

注:9、报告期末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
注:10、报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:11、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:11.2 本基金股指期货投资情况说明
注:11.3 本基金股指期货投资情况说明

注:12、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:12.1 本基金国债期货投资情况说明

注:12.2 本基金国债期货投资情况说明
注:13、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:13.1 本基金国债期货投资情况说明
注:13.2 本基金国债期货投资情况说明

注:14、报告期末处于转股期的可转换债券持仓和损益明细
注:14.1 报告期末处于转股期的可转换债券持仓和损益明细

注:14.2 报告期末处于转股期的可转换债券持仓和损益明细
注:15、报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:15.1 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:15.2 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:16、报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:16.1 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:16.2 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17、报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.1 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.2 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.3 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.4 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.5 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.6 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.7 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.8 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.9 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.10 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.11 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.12 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.13 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.14 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.15 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.16 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.17 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.18 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.19 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.20 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.21 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.22 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.23 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.24 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.25 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.26 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.27 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.28 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.29 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.30 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.31 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.32 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.33 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.34 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.35 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.36 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.37 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.38 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.39 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.40 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.41 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.42 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.43 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.44 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明

注:17.45 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明
注:17.46 报告期末前十名股票公允价值变动情况说明