

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
送刊日期:2014年3月31日
9.1 重要提示及目录

基金的管理人、监督权人所投资基金不存在虚假记载、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相应的法律责任。本基金在募集时依法披露了基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要等基金信息，基金合同、托管协议和招募说明书自基金成立之日起生效，基金产品资料概要自基金成立后60个工作日内披露，基金合同、托管协议和招募说明书自基金成立后6个月内更新，更新的内容包括但不限于基金投资组合、基金业绩表现、财务会计报告、费用计提和支付方式等，但更新费用计提和支付方式等信息不以单独篇章披露。

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，投资者应认真阅读相关基金的招募说明书及基金合同。

本基金报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 国投瑞银深证300指数分级证券投资基金
基金主代码 161207
基金运作方式 约定期开放式
基金合同生效日 2009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
基金类型 封闭式
基金规模 324,670,591.41
基金合同生效日期 不定期开放
基金销售机构 深圳证券交易所
上市地点 深圳证券交易所
基金销售机构的市场准入情况 2009年11月19日
下属分级基金的基金简称 国投瑞银深证300指数分级证券投资基金(场内简称“瑞和深证”及“瑞和深证见份额”)和场外简称“瑞和深证”
下属分级基金的交易代码 161207 150009 150009
报告期末下属分级基金的份额总额 145,116,571.41 89,777,000.00 89,777,000.00

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金通过拟订的投资策略及投资管理，实现对深证300指数的有效跟踪，力求将基金净值增长率与同期深证300指数的净值增长率的偏离度控制在±4%以内。

投资策略 本基金为指数型基金，侧重于采用复制策略投资，按照个股在基准指数中的权重比例构建股票投资组合或以其权重的变动进行相应的调整，以复制指数的收益。或者通过被动投资，以获取指数的平均收益。本基金可以适当参与一级市场新股申购，以及二级市场的股票买卖、权证投资、债券投资、货币市场工具投资、银行存款、短期融资券、回购、资产支持证券、债券回购、国债期货、股指期货、权证、权证类金融产品、股票期权等金融衍生品投资，但须符合法律法规和监管机构的有关规定。

业绩比较基准 95%×深证300指数+5%银行存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为股票型基金，属高风险、高收益品种，其预期收益和预期风险均高于混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人
名称 国投瑞银基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司
姓名 邓凯 赵会军
联系电话 400-880-6868 010-66107999
电子邮箱 service@ubc.com.cn
客户服务电话 400-880-6868 95588
传真 0755-92040488 010-66107998

2.4 信息披露方式

基金管理人应当定期公告的管理人互联网网址 <http://www.ubdc.com>

基金管理人应当公告的基金账户地点 深圳市福田区金田路4028号招银金融中心46层

3. 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

项目	2013年末	2012年末	2011年末
本期已实现收益	-17,422,979.36	-301,551,559.39	-162,248,991.76
本期利润	-17,849,305.47	85,757,588.17	-439,234,236.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0446	0.0832	-0.2226
本期基金份额净值增长率	-5.76%	7.76%	-24.41%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5798	-0.5689	-0.3693
期末基金资产净值	306,837,040.88	773,297,795.78	1,254,192,823.36
期末基金份额净值	0.9459	1.0860	0.8910

注:1.本例已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益。
2.对期末可供分配利润,采用期末可供分配利润中对基金份额持有人已实现部分的孰低数(即,根据基金合同约定的利润分配原则和方法计算出的现金收益分额与未分配利润之和的孰低数)确定,以便体现公允价值变动损益的原则。
3.以上所列各项基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金所产生的申购赎回费用(例如申购赎回费或基金转换费等),计入费用后的实际收益水平以定期报告为准。

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

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符得基金合同及招募说明书有关资产配置比例的约定。

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效以来,每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较是以人民币元为单位的基金净值收益率,指数型基金,对账簿300指数成份股的配置基准为95%,故以此为业绩比较基准。

2. 基金绩效比较基准

3.2.2 基金合同生效以来基金的业绩评价

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金的契约,在分红和小股东的申请下,瑞和深证见份额的存续期内,本基金(包括瑞和300份额、瑞和深证份额和瑞和深证见份额)不进行收益分配。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介

4.1.1 基金管理人

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司,旗下融基基金管理有限公司,经中国证监会监督管理委员会批准,于2002年6月1日正式成立,注册资本人民币亿元,公司是中国第一对外外汇贷款比例达40%的合资基金管理公司,公司股东为北京信托有限公司(国家开发投资公司的全资子公司)及中国银行股份有限公司(UBS AG)。公司秉承“诚实、专业、稳健”的经营理念,建立了有效的风险管理及控制架构,以“诚信、客户至上、专业负责、社会贡献”作为企业的企业文化。截至2013年12月底,公司有员工146人,其中90人具有硕士及以上学位,其中博士1人,硕士85人,本科53人。

4.1.2 基金经理简介

任本基金基金经理时间:2009年10月14日至2013年12月31日

姓名 职务 任期从年月 日 至 年月 日 说明

LU RONG QIANG 本基金基金经理 2009年10月14日 - 14 大利和资本,澳大利亚新南威尔士大学金融学硕士,具有基金从业经验,曾任国投瑞银基金管理有限公司投资经理,投资分析师,股权投资部研究员,股权投资部基金经理,现任国投瑞银基金管理有限公司基金经理。曾任国投瑞银基金管理有限公司基金经理,现任国投瑞银基金管理有限公司基金经理。

殷海飞 本基金基金经理 2013年09月26日 - 7 曾任国投瑞银基金管理有限公司基金经理,现任国投瑞银基金管理有限公司基金经理。

注:任职日期和离任日期均按公司作出决定后正式对外公告之日,证券业协会的公告遵从行业协会《证券从业人员资格管理暂行办法》的规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

管理人严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理制度,并建立了公平交易管理制度,并不断完善了相关制度。

4.2.2 管理人对报告期内基金异常交易行为的专项说明

4.2.3 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.4 管理人对报告期内基金投资策略的专项说明

4.2.5 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.6 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.7 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.8 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.9 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.10 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.11 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.12 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.13 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.14 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.15 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.16 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.17 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.18 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.19 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.20 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.21 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.22 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.23 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.24 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.25 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.26 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.27 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.28 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.29 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.30 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.31 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.32 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.33 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.34 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.35 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.36 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.37 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.38 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.39 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.40 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.41 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.42 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.43 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.44 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.45 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.46 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.47 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.48 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.49 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.50 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.51 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.52 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.53 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.54 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.55 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.56 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.57 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.58 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.59 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.60 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.61 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明

4.2.62 管理人对报告期内基金投资组合运作的专项说明