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:2011年08月29日

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金		
基金简称	国投瑞银沪深300指数分级		
基金主代码	161207		
基金运作方式	契约型开放式。 本基金的基金份额包括本基金之基础份额(简称:瑞和300份额)、本基金之小康份额(简称:瑞和小康份额)与本基金之远见份额(简称:瑞和远见份额)。其中,瑞和小康份额、瑞和远见份额的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。瑞和300份额开通场外与场内两种方式的申购与赎回,瑞和小康份额与瑞和远见份额在深圳证券交易所上市交易。		
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		
报告期末基金份额总额	2,064,209,880.09		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2009年11月19日		
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞和沪深300指数(场内简称:瑞和300")	国投瑞银瑞和小康沪深300指数(场内简称:瑞和小康")	国投瑞银瑞和远见沪深300指数(场内简称:瑞和远见")
下属分级基金的交易代码	161207	150008	150009
报告期末下属分级基金的份额总额	864,116,278.09	600,046,801.00	600,046,801.00

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深300指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪基准指数。 当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如股权分置改革等)导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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
信息披露负责人	姓名	包爱丽	赵会军
	联系电话	400-880-6868	010-66105799
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105798

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年01月01日-2011年06月30日)
本期已实现收益	-30,192,023.79
本期利润	-48,275,068.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0221
本期基金份额净值增长率	-2.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1032
期末基金资产净值	1,954,049,131.70
期末基金份额净值	0.947

注:1.本期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.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

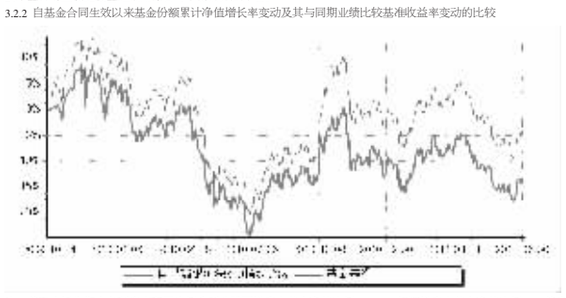
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.72%	1.13%	1.36%	1.13%	0.36%	0.00%
过去三个月	-5.02%	1.05%	-5.26%	1.04%	0.24%	0.01%
过去六个月	-2.67%	1.17%	-2.50%	1.17%	-0.17%	0.00%
过去一年	17.87%	1.34%	17.93%	1.33%	-0.06%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-9.36%	1.41%	-4.32%	1.43%	-5.04%	-0.02%

注:1.本基金业绩比较基准:95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率。本基金是以沪深300指数为标的指数的被动式、指数型基金,对沪深300指数成份股的配置基准为95%,故以此为业绩比较基准,能够准确地反映本基金的投资绩效。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自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



注: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94.53%,权证投资占基金净值比例0%,债券投资占基金净值比例0.02%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例5.52%,符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司(简称:"公司"),原中融基金管理有限公司,经中国证券监督管理委员会批准,于2002年6月13日正式成立,注册资本1亿元人民币,注册地深圳。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司,公司股东为国投信托有限公司(国家开发投资公司的全资子公司)及瑞士银行股份有限公司(UBS AG)。公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效的风险管理及控制架构,以"诚信、客户关注、包容性、社会责任"作为公司的企业文化。公司现有员工161人,其中91人具有硕士或博士学位。截止2011年6月底,公司管理15只基金,其中包括2只创新型分级基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
LU RONG QIANG	本基金基金经理、国际业务部副总监	2009年10月14日	-	11	澳大利亚籍,澳大利亚新南威尔士大学基金管理专业硕士,具有基金从业资格。曾任康联首域投资基金公司投资经理、投资分析师;联邦基金公司数量分析员、投资绩效分析员;美世投资管理顾问公司投资分析师。2008年2月加入国投瑞银。现兼任国投瑞银新兴市场股票(QDII-LOF)基金基金经理。
熊志勇	本基金基金经理	2010年11月27日	-	6	中国籍,英国考文垂大学博士研究生,具有基金从业资格。曾任职于天狮投资中心、华安基金管理有限公司,从事量化分析和证券研究工作。2009年12月加入国投瑞银。

注:1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2.熊志勇先生自2011年08月17日起不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内,基金的投资决策规范,基金运作合法合规,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,本公司未管理其他投资风格与本基金相似的投资组合,不存在投资风格相似的不同投资组合之间的业绩表现差异超过5%之情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,针对严峻的通胀形式,央行货币政策继续收紧,连续六次上调存款准备金率合计3个百分点,并加息0.5个百分点。受央行紧缩货币政策的影响,货币信贷增速持续回落,资金面不断收紧,中国宏观经济明显放缓,6月份PMI制造业指数跌至50.9的历史同期低点,而在考虑通胀因素后的社会消费品零售总额实际增速也滑落到历史较低水平。尽管前5个月固定资产投资增速还维持在相对较高水平,6月份放缓迹象也初步显现。在遭受希腊债务危机困扰和日本经济地震以及高油价冲击后,海外经济放缓趋势也非常明显。股市方面,上半年沪深300指数先扬后抑,1月下旬开始震荡上行,最高涨幅接近15%,4月上旬大盘开始回落,截止到报告期末,上半年沪深300指数整体下跌2.69%。基金投资操作上,作为指数基金,投资操作以严格控制跟踪误差为主,积极应对成分股调整、成分股替代停牌机会成本、同时也密切关注基金申购赎回及市场出现结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.947元,本报告期份额净值增长率为-2.67%,同期业绩基准增长率为-2.50%,基金净值增长率落后于业绩基准收益率0.17%,落后基准主要原因在于成份股调整和申购赎回影响。报告期内,日均跟踪误差为0.06%,年化跟踪误差为0.94%,符合基金合同约定的跟踪误差不超过0.35%以及4.0%的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年下半年,我们预计随着包括日本地震在内的短期供应冲击对经济增长的负面影响逐渐消退,全球经济增速将有所反弹,但总体而言,受制于发达经济体财政刺激政策逐步退出、全球范围内通胀压力尚未缓解,全球经济增速反弹的幅度也相对有限。从国内来看,由于政府紧缩措施将继续发挥作用,我们预计三季度中国宏观经济将继续回落,进入四季度逐步企稳并有所回升,其中,投资同比增速稳中趋降,消费增速在经历上半年明显放缓后将趋于平稳,出口增速将先抑后扬,CPI自高位缓慢回落,通胀压力将逐步缓解。由于短期内CPI仍处在高位,我们预计三季度央行的货币政策仍难以放松,进入4季度,央行的货币政策或转为中性。

作为国内首只创新型分级指数基金,本基金将恪守基金合同,继续系统化、科学化地采取指数化投资策略,做好跟踪误差管理。积极应对成份股调整、基金申购赎回、自身费用计提等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争为市场提供一个清晰透明、可靠可信的资产配置型的创新型指数投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估,并对基金估值程序进 行监督;估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等 事项,估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以 及监察稽核部指定人员;运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,议定基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管理人委派了基金经理人参与估值的相关成员均具有相应 的专业胜任能力和相关工作经历。

本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基 金经理作为估值小组成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值小组提供估值参考信息,参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的 证券,基金管理人及时启动特别估值程序,由估值小组讨论议定特别估值方案并与托管 行沟通,在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定,在瑞和小康份额、瑞和远见份额的存续期内,本基金(包括瑞和300份额、瑞和小康份额、瑞和远见份额)不进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年上半年,本基金托管人在对国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

2011年上半年,国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金2011年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

报告截止日:2011年06月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年06月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款		107,330,309.54	129,622,802.01
结算备付金		564,729.43	3,742,858.06
存出保证金		409,553.98	556,335.49
交易性金融资产		1,847,590,509.35	2,181,344,772.93
其中:股票投资		1,847,257,850.35	2,181,344,772.93
基金投资		-	-
债券投资		332,659.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		21,093.09	28,623.04
应收股利		1,871,265.80	-
应收申购款		10,889.80	33,533.49
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,957,798,350.99	2,315,328,925.02
负债和所有者权益		本期末 2011年06月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		574,705.91	1,719,187.13
应付管理人报酬		1,570,863.68	2,021,572.93
应付托管费		345,590.00	444,746.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,058,137.91	1,371,140.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		199,921.79	106,462.28
负债合计		3,749,219.29	5,663,109.21
所有者权益:			
实收基金		2,156,637,092.93	2,480,213,685.65
未分配利润		-202,587,961.23	-170,547,869.84
所有者权益合计		1,954,049,131.70	2,309,665,815.81
负债和所有者权益总计		1,957,798,350.99	2,315,328,925.02

注:1.报告截止日2011年6月30日,国投瑞银瑞和沪深300指数份额净值0.947元,国投瑞银瑞和小康沪深300指数份额净值0.947元,国投瑞银瑞和远见沪深300指数份额净值0.947元;基金份额总额2,064,209,880.09份,其中国投瑞银瑞和沪深300指数份额864,116,278.09份,国投瑞银瑞和小康沪深300指数份额600,046,801份,国投瑞银瑞和远见沪深300指数份额600,046,801份。

6.2 利润表

会计主体:国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

本报告期:2011年01月01日-2011年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年01月01日-2011年06月30日	上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日
一、收入		-32,278,653.69	-844,622,186.31
1.利息收入		448,432.14	602,307.17
其中:存款利息收入		441,869.15	602,307.17
债券利息收入		6,562.99	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-15,122,449.50	-113,584,890.70
其中:股票投资收益		-31,873,647.55	-126,945,056.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益		397,927.47	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		16,353,270.58	13,360,166.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-18,083,044.84	-732,320,060.68
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		478,408.51	680,457.90
减:二、费用		15,996,414.94	20,542,099.71
1.管理人报酬		10,572,740.45	13,996,938.57
2.托管费		2,326,002.96	3,079,326.51
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2,889,486.48	3,272,032.84
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		208,185.05	193,801.79
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-48,275,068.63	-865,164,286.02
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-48,275,068.63	-865,164,286.02

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

本报告期:2011年01月01日-2011年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年01月01日-2011年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,480,213,685.65	-170,547,869.84	2,309,665,815.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-48,275,068.63	-48,275,068.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-323,576,592.72	16,234,977.24	-307,341,615.48
其中:1.基金申购款	525,009,178.03	-5,555,477.40	519,453,700.63
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-848,585,770.75	21,790,454.64	-826,795,316.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,156,637,092.93	-202,587,961.23	1,954,049,131.70
	上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日		
项 目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,138,781,189.76	188,474,983.70	3,327,256,173.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-865,164,286.02	-865,164,286.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-575,341,414.65	84,442,485.05	-490,898,929.60
其中:1.基金申购款	751,047,434.22	-3,759,526.48	747,287,907.74
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,326,388,848.87	88,202,011.53	-1,238,186,837.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,563,439,775.11	-592,246,817.27	1,971,192,957.84

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 会计差错更正的说明

本基金于本期末发生会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本基金本报告期关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年01月01日-2011年06月30日	上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日
当期应支付的管理费	10,572,740.45	13,996,938.57
其中:应支付给销售机构的客户维护费	357,482.29	284,766.92

注:支付基金管理人国投瑞银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年01月01日-2011年06月30日	上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日
当期应支付的托管费	2,326,002.96	3,079,326.51

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.22%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	国投瑞银瑞和沪深300指数	国投瑞银瑞和小康沪深300指数	国投瑞银瑞和远见沪深300指数	国投瑞银瑞和沪深300指数	国投瑞银瑞和小康沪深300指数	国投瑞银瑞和远见沪深300指数
基金合同生效日(2009年10月14日)持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
期初持有的基金份额	9,577,988.75	-	-	10,006,700.00	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
期间因拆算变动份额	-	-	-	-428,711.25	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额	9,577,988.75	-	-	9,577,988.75	-	-
占基金总份额比例	1.11%	-	-	1.24%	-	-

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期及上年度可比期间无与除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2011年01月01日-2011年06月30日		上年度可比期间 2010年01月01日-2010年06月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国工商银行股份有限公司	107,330,309.54	435,231.23	111,513,809.36	591,954.30

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2011年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
000652	泰达股份	2010-11-22	重大资产置换	7.68	2011-07-08	7.68	457,682	3,593,729.53	3,514,997.76
000876	新希望	2011-06-29	重大资产重组	19.95	2011-07-05	21.95	42,400	765,983.61	845,880.00
000959	首钢股份	2010-10-29	重大资产重组	4.42	--	--	466,405	2,339,259.27	2,061,510.10
600170	上海建工	2011-06-29	重大资产重组	15.59	2011-07-04	16.25	82,980	1,144,484.48	1,293,658.20
600369	西南证券	2011-03-01	重大资产重组	11.87	2011-08-16	12.49	157,332	2,621,904.06	1,867,530.84
601998	中信银行	2011-06-29	配股发行	4.75	2011-07-07	4.59	1,006,541	5,727,181.40	4,781,069.75

注:本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为质押的债券。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,847,257,850.35	94.35
	其中:股票	1,847,257,850.35	94.35
2	固定收益投资	332,659.00	0.02
	其中:债券	332,659.00	0.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	107,895,038.97	5.51
6	其他资产	2,312,802.67	0.12
7	合计	1,957,798,350.99	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,916,974.55	0.25
B	采掘业	224,144,251.81	11.47
C	制造业	687,084,049.40	35.16
C0	食品、饮料	101,715,855.21	5.21
C1	纺织、服装、皮毛	6,710,484.69	0.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	48,046,716.09	2.46
C5	电子	14,264,793.92	0.73
C6	金属、非金属	177,023,952.56	9.06
C7	机械、设备、仪表	264,033,273.76	13.51
C8	医药、生物制品	71,760,409.95	3.67
C99	其他制造业	3,528,563.22	0.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	39,288,938.59	2.01
E	建筑业	61,793,958.87	3.16
F	交通运输、仓储业	78,775,259.46	4.03
G	信息技术业	60,321,835.49	3.09
H	批发和零售贸易	52,840,798.44	2.70
I	金融、保险业	479,266,433.88	24.53
J	房地产业	89,691,177.47	4.59
K	社会服务业	21,581,607.85	1.10
L	传播与文化产业	2,096,164.52	0.11
M	综合类	32,096,400.02	1.64
	合计	1,833,897,850.35	93.85

7.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	13,360,000.00	0.68
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	5,860,000.00	0.30
C7	机械、设备、仪表	7,500,000.00	0.38
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	13,360,000.00	0.68

7.3 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	4,962,678	64,614,067.56	3.31
2	601318	中国平安	1,180,326	56,974,336.02	2.92
3	600016	民生银行	8,586,422	49,200,198.06	2.52
4	601328	交通银行	7,216,981	39,982,074.74	2.05
5	601088	中国神华	1,195,781	36,040,839.34	1.84
6	600000	浦发银行	3,523,988	34,676,041.92	1.77
7	601166	兴业银行	2,539,110	34,227,202.80	1.75
8	600030	中信证券	2,612,388	34,170,035.04	1.75
9	000002	万 科A	3,486,973	29,464,921.85	1.51
10	600519	贵州茅台	132,881	28,254,487.03	1.45

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600765	中航重机	500,000	7,500,000.00	0.38
2	600581	八一钢铁	400,000	5,860,000.00	0.30

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

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(%)
1	600893	航空动力	18,136,863.26	0.79
2	000858	五 粮 液	15,695,836.45	0.68
3	600104	上海汽车	15,416,100.11	0.67
4	600585	海螺水泥	15,