国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金招募说明书摘要

(2013年3月更新)

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

【重要提示】

本基金由瑞福分级基金转型而成。瑞福分级基金转型经2012年6月8日瑞福分级基金份额持有人大会以现场方式召开,大会讨论并通过了《关于国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金合同延期及修改相关事项的议案》,经中国证监会《关于核准国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2012]880号)文核准,基金份额持有人大会决议生效。依据基金份额持有人大会决议,自2012年7月17日起,瑞福分级基金转型为"国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金",即本基金。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的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。从分级运作期内投资者具体持有的基金份额来看,瑞福优先份额将表现出低风险、低收益的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;瑞福进取份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

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。本基金投资于深证100指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%;投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化、基金份额上市交易价格波动引致的投资风险,由投资者自行负担。

本招募说明书所载内容截止日期为2013年1月17日,其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2012年12月31日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司于2013年1月31日对本招募说明书(2013年3月更新)进行了复核。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:国投瑞银基金管理有限公司

住所:上海市虹口区东大名路638号7层

办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

法定代表人:钱蒙

设立日期:2002年6月13日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会,证监基金字【2002】25号

组织形式:有限责任公司

注册资本:壹亿元人民币

存续期限:持续经营

联系人:杨蔓

联系电话:(0755)83575992

传 真:(0755)82904048

股权结构:

股东名称	持股比例
国投信托有限公司	51%
瑞士银行股份有限公司(UBS AG)	49%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

钱蒙先生,董事长,中国籍,硕士,现任国家开发投资公司党组成员、副总裁、国投信托有限公司董事长。曾任国家开发投资公司总裁助理,中国包装总公司党组书记、总经理,国投财务有限公司董事长,国投资产管理公司总经理,安徽省六安市市委副书记,兴业基金管理有限公司董事,国家开发投资公司金融投资部总经理、经营部主任,国投机轻有限公司副总经理,国家开发投资公司机电轻纺业务部业务经理,国家机电轻纺投资公司工程师、副处长,国家计委干部、主任科员。

凌新源先生,董事,中国籍,硕士,高级经济师。现任瑞士银行(香港)环球资产管理公司董事总经理,中国区主席。曾任华夏基金管理有限公司董事长,北京证券有限公司董事长,华夏证券有限公司执行副总裁,中国钢铁工贸集团公司总裁助理,中国冶金进出口总公司总裁助理,北京国际信托投资公司业务部副经理。

王彬女士,董事,中国籍,硕士,高级经济师。现任国投信托有限公司副总经理兼董事会秘书。曾任国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书,国投信托有限公司资产管理部经理,北京国际电力开发投资公司、北京京能热电股份有限公司董事会秘书。

董日成先生,董事,中国香港籍,英国sheffield大学学士,现任瑞银环球资产管理公司中国区董事总经理。曾任瑞银环球资产管理公司中国区业务经理、执行董事,瑞银环球资产管理对冲基金亚太区首席营运官,瑞银环球资产管理台湾总经理,香港瑞银财富管理部门主管,国投瑞银基金管理有限公司的代总经理和首席营运官,美林投资经理人公司亚太地区首席营运官,美国国际集团亚太地区的金融及营运领域担任多个重要职务等。

李哲平先生,独立董事,中国籍,金融学硕士,现任当代金融家杂志社主编,中信银行独立董事、中航证券有限公司独立董事。曾任统信资产评估公司董事长、中国证券报理论版主编、中国金融培训中心助教。

史克通先生,独立董事,中国籍,法学学士,现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、律师,主要从事公司经常性业务及IPO、上市公司再融资及重大重组、证券投资基金及私募基金的设立、投资等业务;兼任中国忠旺控股有限公司独立董事。曾任职于山东鲁中律师事务所、北京市京都律师事务所。

龙涛先生,独立董事,中国籍,硕士。现任北京海问投资咨询有限公司董事长、中央财经大学会计系副教授,兼任庆铃汽车股份有限公司和北辰实业股份有限公司独立董事。曾任华夏基金管理有限公司独立董事,曾在毕马威国际会计纽约分部担任审计和财务分析工作。

2、监事会成员

叶锦华先生,监事长,中国香港籍,澳大利亚University of Technology, Western Australia学士,现任瑞银环球资产管理公司亚太区财务总监、董事总经理。曾任瑞银环球资产管理财务部执行董事、财务总监,并曾在港基银行和恒生银行等机构担任重要职务。

展飞先生,监事,中国籍,硕士,现任国投信托有限公司固有业务总部负责人。曾任国家开发投资公司战略发展部一级项目经理助理,国投信托有限公司信托资产运营部和信托资产管理部项目经理。

黄玲玖女士,监事,中国籍,硕士,经济师,现任本公司监察稽核部顾问。曾任本公司监察稽核部总监、中融基金管理有限公司董事会秘书兼监察稽核部总监,河北证券有限责任公司深圳营业部副总经理,中国旅游信托投资有限公司深圳证券营业部总经理,建行辽宁省信托投资公司深圳证券营业部副总经理等。

3、公司高级管理人员

刘纯亮先生,副总经理代任总经理,中国籍,经济学学士,中国注册会计师协会和特许公认会计师公会(ACCA)会员。曾任北京建工集团总公司会计、柏德豪(BDO)关黄陈方国际会计师行会计师、中国证券监督管理委员会稽查员、博时基金管理有限公司监察法律部负责人、督察长。

盛斌先生,副总经理,中国籍,美国哥伦比亚大学国际关系学硕士。曾任国信证券北京投行部项目负责人、万家基金管理有限公司金融工程部总监、总经理助理兼市场总监。

路博先生,副总经理,中国籍,学士,会计师。曾任北京华讯通信发展总公司财务中心会计、主管会计,国投建化实业公司项目部、开发部、贸易部、计财部业务主管及会计主管,国家开发投资公司计划财务部资金处业务主管,国投信托有限公司财务部、资产管理部、综合管理部负责人。

包爱丽女士,督察长,中国籍,美国哥伦比亚大学硕士。曾任贝莱德资产管理有限公司资产管理核算部、共同基金部业务主管,银华基金管理有限公司战略发展部总监,本公司产品及业务拓展部总监、总经理助理。

注:2013年2月23日本基金管理人在指定媒体刊登公告:包爱丽女士不再担任本公司督察长,现任本公司副总经理;督察长一职由刘凯先生继任。

4、本基金基金经理

LU RONGQIANG先生,澳大利亚籍,澳大利亚新南威尔士大学基金管理专业硕士,13年证券从业经历。曾在澳大利亚先后任康联首域投资基金管理公司投资经理、投资分析师;联邦基金管理有限公司数量分析员、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月加入本公司,现任国际业务部副总监。2009年10月14日起任国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金经理,2012年10月30日起兼任国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金。曾于2010年6月10日至2012年3月9日担任国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理:

黄顺祥先生,2012年7月17日(本基金基金合同生效日)至2012年10月29日。

朱红裕先生,2012年7月17日(本基金基金合同生效日)至2012年10月29日。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

(1)投资决策委员会主席:刘纯亮先生,副总经理代任总经理

(2)投资决策委员会成员:

刘新勇先生:总经理助理兼专户投资部总监,投资经理

徐炜哲先生:基金投资部副总监,基金经理

刘杰文先生:研究部总监

陈翅凯先生:固定收益组总监,基金经理

蔡玮菁女士:专户投资部,投资经理

(3)督察长列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币349,018,545,827元

联系电话:010-66105799

联系人:赵会军

二、主要人员情况

截至2012年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工157人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2012年12月,中国工商银行共托管证券投资基金282只,其中封闭式5只,开放式277只。自2003年以来,本行连续九年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的35项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

(一)瑞福优先销售机构

1、场外直销机构

国投瑞银基金管理有限公司直销中心

办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

法定代表人:钱蒙

电话:(0755)83575993 83575992

传真:(0755)82904048 82904007

联系人:曹丽丽、杨蔓

客服电话:400-880-6868

网站:www.ubssdic.com

2、场外代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

传真:(010)66107914

联系人:陶仲伟

客服电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构为本基金的场外基金代销机构,并及时公告。

(二)瑞福进取的销售机构

1、场内代销机构

瑞福进取的场内代销机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,包括:国泰君安、广发证券、国信证券、招商证券、中信证券、海通证券、中银万国、西南证券、华龙证券、大同证券、民生证券、山西证券、长江证券、中信万通证券、广州证券、兴业证券、华泰证券、渤海证券、中信证券(浙江)、万联证券、国元证券、湘财证券、东吴证券、东方证券、光大证券、上海证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、东北证券、南京证券、长城证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、恒泰证券、中银国际证券、齐鲁证券、华西证券、国盛证券、新时代证券、华林证券、中金公司、宏源证券、华安证券、世纪证券、德邦证券、金元证券、西部证券、东海证券、信泰证券、中航证券、第一创业证券、中信建投证券、财通证券、安信证券、银河证券、华鑫证券、瑞银证券、国金证券、中投证券、中山证券、红塔证券、日信证券 、西藏证券 、方正证券、联讯证券、江海证券、银泰证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、爱建证券、英大证券等。

2、场外直销机构

国投瑞银基金管理有限公司直销中心(仅指直销柜台,不含网上交易)

办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

法定代表人:钱蒙

电话:(0755)83575993 83575992

传真:(0755)82904048 82904007

联系人:曹丽丽、杨蔓

客服电话:400-880-6868

网站:www.ubssdic.com

(三)瑞福进取份额的跨系统转托管

本基金瑞福进取份额可以办理跨系统转托管业务。场外瑞福进取份额持有人可以通过跨系统转托管将瑞福进取份额转至场内进行交易。

本基金瑞福进取份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

二、注册登记机构

(一)瑞福优先注册登记机构

名称:国投瑞银基金管理有限公司

住所:上海市虹口区东大名路638号7层

办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

法定代表人:钱蒙

电话:(0755)83575836

传真:(0755)82912534

联系人:冯伟

客服电话:400-880-6868

(二)瑞福进取及本基金转为LOF后的注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区太平桥大街17号

办公地址:北京西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:(010)59378839

传真:(010)59378907

联系人:朱立元

三、为瑞福分级基金募集出具法律意见书的律师事务所

名称:北京市金杜律师事务所

住所:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层

办公地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层

负责人:王玲

经办律师:靳庆军、宋萍萍

联系人:宋萍萍

电话:(010)58785588

传真:(010)58785599

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:(021)23236837

传真:(021)23238800

经办注册会计师:薛竞、张晓艺

联系人:张晓艺

第四部分 基金的名称

国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

第五部分 基金的类型

本基金类型:股票型。基金运作方式:契约型。

第六部分 基金的投资目标

本基金的投资目标:本基金通过被动的指数化投资管理,实现对深证100价格指数的有效跟踪,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。

第七部分 基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于深证100指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%;投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

第八部分 基金的投资策略

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。

(1)类别资产配置

本基金采用自上而下的两层次资产配置策略,首先确定基金资产在股票和其他资产之间的配置比例,然后通过指数复制的方法,确定各成份股的配置比例。

(2)股票组合构建与调整

1)股票组合构建

本基金采用指数复制构建股票组合中将使用以下模型:

[illegible]

2)股票组合调整

根据基准指数成份股及其权重的变动、法律法规中的投资比例限制、增发新股等情形,对股票投资组合及时进行适度调整。

① 基于基准指数成份股及其权重变动的调整

② 成份股流动受限时的调整

③ 成份股基本面发生重大不利变化时的调整

为保护基金份额持有人利益,当某成份股基本面发生重大不利变化,预计将被剔除出成份股时,本基金将提前调降该成份股的配置权重,并用替代股票进行替代,也可根据指数编制规则前瞻性地预测入选股票来作为备选替代股票。

④ 一般情况下,本基金仅参与有望入选指数成份股的IPO新股申购以及成份股内增发新股的申购。但考虑到国内新股发行上市的市场特点,本基金也参与申购收益率较高的品种,由此得到的非成份股将择机卖出。

⑤ 为有效控制基金的跟踪误差,在市场条件允许的情况下,本基金可能投资于金融衍生工具,以对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

(3)股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货。

本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

深证100价格指数由深圳证券信息公司编制发布,其成份股由在深圳证券交易所上市、公司平均流通市值的比重和平均成交金额的比重排名在前100名的股票构成,对深圳A股市场有很强的代表性。

由于本基金的投资标的为深证100指数成份股及备选股,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%,因此,本基金将业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,基金管理人和基金托管人协商一致后可以变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种。

第十一部分 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2012年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、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	6,991,619,120.96	94.58
	其中:股票	6,991,619,120.96	94.58
2	固定收益投资	298,895,000.00	4.04
	其中:债券	298,895,000.00	4.04
	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	79,818,290.10	1.08
6	其他各项资产	21,992,846.37	0.30
7	合计	7,392,325,257.43	100.00

2、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	47,434,412.58	0.64
B	采掘业	462,349,508.25	6.26
C	制造业	3,839,538,572.48	52.01
C0	食品、饮料	768,866,395.25	10.41
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	214,655,815.29	2.91
C5	电子	475,657,557.71	6.44
C6	金属、非金属	639,291,423.55	8.66
C7	机械、设备、仪表	1,311,721,384.74	17.77
C8	医药、生物制品	429,345,995.94	5.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	26,267,448.48	0.36
E	建筑业	104,161,004.40	1.41
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	165,278,192.97	2.24
H	批发和零售贸易	220,741,584.89	2.99
I	金融、保险业	712,373,048.15	9.65
J	房地产业	939,082,416.76	12.72
K	社会服务业	275,577,379.27	3.73
L	传播与文化产业	81,579,903.01	1.11
M	综合类	117,235,649.72	1.59
	合计	6,991,619,120.96	94.71

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

3、按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)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	000002	万 科A	52,653,864	559,184,035.68	7.57
2	000651	格力电器	12,783,234	325,972,467.00	4.42
3	000858	五粮液	9,814,195	277,054,724.85	3.75
4	000001	平安银行	15,234,807	244,061,608.14	3.31
5	000157	中联重科	25,004,931	230,295,414.51	3.12
6	002024	苏宁电器	26,233,305	174,451,478.25	2.36
7	000024	招商地产	5,267,710	157,451,851.90	2.13
8	000776	广发证券	10,146,698	156,462,083.16	2.12
9	000069	华侨城A	20,103,524	150,776,430.00	2.04
10	000338	潍柴动力	5,429,329	137,416,316.99	1.86

(2)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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、按券种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	148,890,000.00	2.02
2	央行票据	49,965,000.00	0.68
3	金融债券	100,040,000.00	1.36
	其中:政策性金融债	100,040,000.00	1.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	298,895,000.00	4.05

5、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120218	12国开18	1,000,000	100,040,000.00	1.36
2	129907	12贴现国债07	1,000,000	99,270,000.00	1.34
3	1001042	10央行票据42	500,000	49,965,000.00	0.68
4	129908	12贴现国债08	500,000	49,620,000.00	0.67

6、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

8、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2)基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3)其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,963,313.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,029,533.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,992,846.37

(4)持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	559,184,035.68	7.57	重大事项停牌

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资股票中未存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现详见下表:

国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止2012年12月31日)

阶段	净值增长率①	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
2012.08.14(基金分级运作起始日)至2012.12.31	1.20%	1.37%	0.97%	1.37%	0.23%	0.00%
自基金合同生效至今	1.20%	1.37%	0.97%	1.37%	0.23%	0.00%

第十三部分 费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金标的指数使用费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在分级运作期内,本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。在根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金(LOF)之后,本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。

管理费的计算方法如下:

H=E×管理费比例÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在分级运作期内,本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。在根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金(LOF)之后,本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。

托管费的计算方法如下:

H=E×托管费比例÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本基金分级运作期起始日起开始计提,每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二,按季支付,自分级运作期起始日所在季度的下一季度起,指数使用费收取下限为每季度人民币5万元,即若不足人民币5万元则按照人民币5万元收取。

指数使用费的计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

指数使用费从本基金分级运作期起始日开始每日计算,逐日累计。

指数使用费每日计提,逐日累计,按季支付,由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令,基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

在基金存续期内,如果基金管理人与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议中关于"指数使用费"的内容有所修改的,将按照最新的内容进行费用计提和支付,此事无须召开份额持有人大会。

4、上述一、基金费用的种类中第4-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理方法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2012年7月12日刊登的本基金招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

1、在"重要提示"部分,更新了招募说明书内容的截止日期及投资组合报告的截止日期。

2、在"第三部分、基金管理人"部分,更新了基金管理人主要人员情况的信息。

3、在"第四部分、基金托管人"部分,更新了基金托管人基本情况、主要人员情况和基金托管业务经营情况的信息。

4、在"第五部分、相关服务机构"部分,增加了基金份额销售机构的信息,增加了新增代销机构的概况,更新了经办注册会计师部分信息。

5、在"第六部分、基金的历史沿革"部分,更新了历史沿革内容。

6、在"第七部分、基金过渡期情况"删除了过渡期安排的相关内容,增加了过渡期基金募集情况的信息。

7、在"第十三部分、基金的投资"部分,增加了本基金最近一期投资组合报告的内容。

8、增加了"第十四部分、基金的业绩"部分,说明了基金合同生效以来的投资业绩。

9、在"第二十五部分、对基金份额持有人的服务"部分,更新了相关服务信息。

10、在"第二十六部分、其他应披露事项"部分,更新披露了自上次招募说明书截止日以来涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录国投瑞银基金管理有限公司网站www.ubssdic.com。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一三年三月一日

证券代码:000507 证券简称:珠海港 公告编号:2013-012

珠海港股份有限公司配股提示性公告

特别提示

本公司及董事局全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要提示

1、本次配股简称:珠海A1配;代码:080507;配股价格:3.01元/股。

2、配股缴款起止日期:2013年2月28日至2013年3月6日的深圳证券交易所正常交易时间,请股东注意申购时间。

3、本次配股网上认购期间公司股票停牌,2013年3月7日(T+6日)验资,公司股票继续停牌;2013年3月8日(T+7日)将公告配股发行结果,公司股票复牌交易。

4、《珠海港股份有限公司配股说明书摘要》刊登于2013年2月25日(T-2日)的《证券时报》、《中国证券报》上,《珠海港股份有限公司配股说明书》全文及其他相关资料刊载于2013年2月25日(T-2日)巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn);投资者欲了解本次发行的详细情况,请仔细阅读相关内容。

5、配股上市时间在配股发行成功后根据深圳证券交易所的安排确定,将另行公告。

6、珠海港股份有限公司(以下简称"发行人"或"公司")本次配股方案已经2011年11月10日公司第七届董事局第四十六次会议审议通过,并提交公司2011年第三次临时股东大会审议批准。2011年12月21日,公司召开2011年第三次临时股东大会审议通过了本次配股的部分议案及关于提请股东大会授权董事局全权办理本次配股相关具体事宜的议案。2011年12月22日,公司召开第七届董事局第四十八次会议对本次配股募集资金投向进行了修订。2012年4月16日,公司召开第七届董事局第五十五次会议审议通过了确定本次配股的配股比例的议案。2012年10月30日,公司召开第八届董事局第十次会议审议通过了延长本次配股相关方案决议有效期限的议案,并提交公司2012年第五次临时股东大会审议批准。2012年11月15日,公司召开2012年第五次临时股东大会审议通过了延长本次配股相关方案决议有效期限的议案。

本次配股方案已获得中国证券监督管理委员会发行审核委员会2012年第207次会议审核通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]146号文核准。

一、本次发行的基本情况

1、配股股票类型及面值:人民币普通股(A股),每股面值1.00元。

2、配股比例及数量:以本次发行股权登记日2013年2月27日收市后公司总股本62,099.5356万股为基数,每10股配售3股,可配售股份总额为18,629.8607万股。

3、发行人第一大股东珠海港控股集团有限公司已出具承诺函,承诺以现金方式全额认购本次配股中其可认配股份。

4、配股价格:本次配股价格为3.01元/股,配股代码为"080507",配股简称为"珠海A1配"。

5、发行对象:截止2013年2月27日(T日)下午深圳证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的持有发行人股份的全体股东。

6、发行方式:网上定价发行,通过深交所交易系统进行。

7、承销方式:代销。

8、本次配股主要日期:

以下时间均为正常交易日,本次配股主要日期和停牌安排如下:

| 交易日 | 日期 | 配股安排 | 停牌安排 |
|