国投瑞银货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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
报告送出日期:2014年07月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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不则及连带责任。

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2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银货币
基金主代码	121011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年01月19日
报告期末基金份额总额	2,846,694,847.12份
投资目标	在力求基金资产安全性和较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下,依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期,综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款的税后利率:(1-利息税率)×七天通知存款利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。
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

下属两级基金的基金简称	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
下属两级基金的交易代码	121011	128011
报告期末下属两级基金的份额总额	271,132,173.72	2,575,562,673.40

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年04月01日-2014年06月30日)	
	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
1.本期已实现收益	2,248,174.58	34,750,368.75
2.本期利润	2,248,174.58	34,750,368.75
3.期末基金资产净值	271,132,173.72	2,575,562,673.40

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0720%	0.0034%	0.3418%	0.0000%	0.7302%	0.0034%

国投瑞银货币B

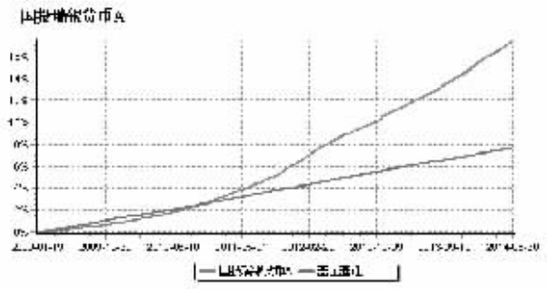
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1323%	0.0034%	0.3418%	0.0000%	0.7905%	0.0034%

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

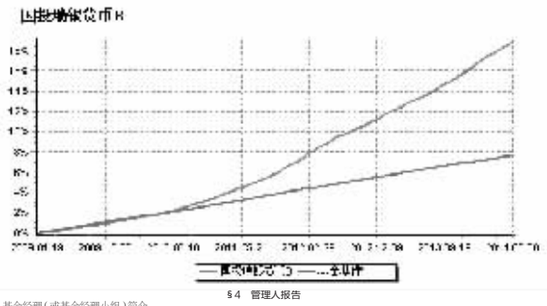
2、本基金的业绩比较基准中,通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期7天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。根据财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知(财税[2008]132号)文件规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。故本基金本报告期以税前七天通知存款利率为业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银货币A



国投瑞银货币B



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
陈翔凯	本基金基金经理、固定收益部总监	2012年09月15日	-	17	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2008年5月加入国投瑞银。先后任职于基金投资部、专户投资部。现任国投瑞银货币市场基金、国投瑞银双债增利债券基金、国投瑞银稳定增利债券基金、国投瑞银中高等级债券基金、国投瑞银瑞易货币市场基金基金经理。
徐栋	本基金基金经理	2013年12月26日	-	5	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2009年7月加入国投瑞银,从事固定收益研究工作。现任国投瑞银货币市场基金和国投瑞银瑞易货币市场基金基金经理。

注: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。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年二季度,受监管部门对银行同业业务监管加强,银行同业融资规模显著缩窄;同时央行定向下调准备金率为市场提供流动性,亦改善了市场主体对未来流动性的预期。受此正面影响,资金价格全线回落,现券收益率也出现大幅下行。一年期金融债收益率从4.85%下行至4.28%;AA级短融主体回落80bp至5.29%。本期间,货币基金减持存款比例,大幅增持长期限短融,保持较长久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本期内,本基金A级份额净值增长率为1.07%,B级份额净值增长率为1.13%,同期业绩比较基准收益率为0.34%。本期内基金份额净值增长率高于基准,主要由于我们较好的把握了市场机会,在收益较高的时候主动拉长久期,获取较多的资本利得。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年二季度,结合目前的经济状况以及趋势数据,我们预计央行会延续二季度的货币资产操作思路,继续保持适度宽松的货币政策,资金价格有望在低位徘徊。基于此,货币基金将在保证流动性充裕基础上,相比二季度保持偏短的组合久期。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	固定收益投资	922,086,594.39	30.06
	其中:债券	922,086,594.39	30.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	405,701,848.56	13.23
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,703,429,379.63	55.53
4	其他资产	36,309,059.59	1.18
5	合计	3,067,526,882.17	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	3.39
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	218,999,690.50	7.69
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	35.17	7.69
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	29.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.41	-
4	90天(含)—180天	1.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	26.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.48	7.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,090,128.43	8.43
	其中:政策性金融债	240,090,128.43	8.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	681,996,465.96	23.96
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	922,086,594.39	32.39
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	40,123,739.77	1.41

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041456014	14中铝业CP002	1,100,000	110,884,518.31	3.90
2	100209	10国开09	1,000,000	100,071,756.15	3.52
3	140213	14国开13	1,000,000	99,894,632.51	3.51
4	011420005	14中铝SCP005	800,000	80,171,415.32	2.82
5	041472010	14宁国投CP001	800,000	80,005,493.45	2.81
6	041454002	14川交投CP001	600,000	60,506,171.59	2.13
7	011490001	14苏交通SCP001	500,000	50,071,941.40	1.76
8	041452034	14渝南CP001	500,000	50,050,888.02	1.76
9	041459044	14青松CP001	500,000	50,003,667.80	1.76
10	041466016	14京昊华CP001	500,000	50,001,345.96	1.76

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1059%
报告期内偏离度的最低值	0.0218%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0693%

5.7 报告期末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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.8.2 本基金本报告期内无剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,122,975.07
4	应收申购款	21,186,084.52
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	36,309,059.59

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

本基金本期未持投托管行股票、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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	国投瑞银货币A	国投瑞银货币B
本报告期期初基金份额总额	217,209,331.87	4,328,353,645.20
本报告期基金总申购份额	192,815,730.68	5,216,410,808.49
减:本报告期基金总赎回份额	138,892,888.83	6,969,201,780.29
本报告期期末基金份额总额	271,132,173.72	2,575,562,673.40

注:总申购份额含转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额,总赎回份额含转换出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2014年04月21日	73,021.58	73,021.58	-
2	赎回	2014年04月23日	20,451,474.56	20,456,349.34	-

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内基金管理人对本基金暂停及恢复申购(转换转入、大额定期定额投资)业务进行公告,指定媒体公告时间分别为2014年4月25日、2014年5月8日、2014年6月17日、2014年6月26日和2014年7月4日。

2.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为2014年5月10日。

3.报告期内基金管理人对本基金调整申购、赎回及最低持有份额的数额限制进行公告,指定媒体公告时间为2014年5月9日。

4.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为2014年4月19日。

5.报告期内基金管理人对董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况进行公告,指定媒体公告时间为2014年4月12日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银货币市场基金募集的批复》(证监许可[2008]1423号)

《关于国投瑞银货币市场基金备案的确认函》(基金部函[2009]27号)

《国投瑞银货币市场基金基金合同》

《国投瑞银货币市场基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

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2014年第二季度报告原文

9.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址:http://www.ubsdic.com

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

咨询电话:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

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

2014 第二季度 报告

2014年6月30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
报告送出日期:2014年07月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银金融地产ETF(场内简称:金地ETF)
基金主代码	159933
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年09月17日
报告期末基金份额总额	1,531,778,943.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合,并根据标的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。 当预期标的指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为,或因基金的申购与赎回以及其他特殊情况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。 在正常市场情况下,本基金力求将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人将采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 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,以提高投资组合的运作效率。
业绩比较基准	沪深300金融地产指数
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。本基金被动跟踪标的指数,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	9,586,368.81
2.本期利润	40,785,337.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0269
4.期末基金资产净值	1,382,801,464.45
5.期末基金份额净值	0.9027

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、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(例如基金申购赎回费、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 本报告期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

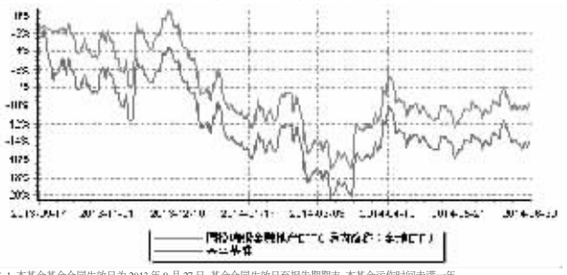
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.14%	0.97%	1.97%	0.98%	1.17%	-0.01%

注:1、本基金标的指数及业绩比较基准为沪深300金融地产指数。

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 基金净值表现

3.2.1 本报告期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:1、本基金基金合同生效日为2013年9月27日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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、量化投资部总监	2013年06月15日	-	14	澳大利亚籍,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,曾任国投瑞银新兴市场基金(QDII-LOF)基金经理,现任国投瑞银瑞福深证100指数分级基金、国投瑞银瑞和沪深300指数分级基金、国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数基金(ETF)及其联接基金基金经理。
殷瑞飞	本基金基金经理	2013年10月26日	-	7	中国籍,博士,具有基金从业资格。曾任职于汇添富基金管理公司。2011年6月加入国投瑞银。现任国投瑞银银福和沪深300指数分级基金和国投瑞银金融地产交易型开放式指数基金基金经理。

注: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。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 公平交易专项说明

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 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度整体宏观环境趋于缓和,在经历了一季度相对低迷的经济数据之后,二季度管理层保增长预期逐步明确,央行对部分金融机构的存款准备金率进行了下调,在公开市场上的资金投放力度也有所加大。PMI等先行指标有所抬头,投资者针对经济的担心阶段性缓解。二季度沪深300指数上涨0.88%,振幅9.05%,创业板指数上涨5.8%,振幅14.6%。

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,积极应对成份股调整、成份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的结构性机会。

4.5 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0.9027元,本报告期份额净值增长率为3.14%,同期业绩比较基准收益率为1.97%,基金净值增长率高于业绩基准收益率,主要受报告期内指数成分股的调整、基金的申购赎回活动、部分利息股息收入扣减费率等综合因素的影响。

报告期内,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0170%,年化跟踪误差为0.6657%,符合基金合同约定的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年跟踪误差控制在2%以内的限制。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,预计在保增长预期下,投资者对经济短期增速下滑的担忧逐步缓解,但是市场仍然面临投资增速下滑带动经济增速回落,以及IPO持续发行的考验。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	1,356,662,739.97	98.03
	其中:股票	1,356,662,739.97	98.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,244,408.39	1.97
8	其他各项资产	54,241.31	-
9	合计	1,383,961,389.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,189,014,630.39	85.99
K	房地产业	163,996,903.06	11.86
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	3,651,206.52	0.26
	合计	1,356,662,739.97	98.11

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末持有积极投资股票。

5.3 期末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

5.3.1 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	601318	中国平安	3,404,212	133,921,700.08	9.68
2	600036	招商银行	11,700,243	119,810,488.32	8.66
3	600016	民生银行	19,240,757	119,485,100.97	8.64
4	601166	兴业银行	8,128,159	81,525,434.77	5.90
5	600000	浦发银行	7,965,967	72,092,001.35	5.21
6	600030	中信证券	5,607,301	64,259,669.46	4.65
7	000002	万科A	6,902,297	57,081,996.19	4.13
8	600837	海通证券	5,766,753	52,765,789.95	3.82
9	601288	农业银行	18,481,500	46,573,380.00	3.37
10	601328	交通银行	11,203,576	43,469,874.88	3.14

5.3.2 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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券资产。

5.5 报告期末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

本基金本报告期末未持有债券资产。

5.6 报告期末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。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和掘益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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,以提高投资组合的运作效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券中,包括"中国平安"3,404,212股,市值13,392万元,占基金资产净值9.68%;根据中国平安保险(集团)股份有限公司2013年10月15日公告,该集团控股子公司"平安证券有限责任公司"收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》,决定对平安证券有限责任公司责令改正给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。基金管理人认为,平安证券投行业务承销佣金收入及投行业务利润占该集团营业收入及集团的净利润的比重较小,本处罚对该集团经营活动没有产生实质性影响,未改变该集团基本面。

本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。

除上述情况外,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。

5.11.2 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。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,816.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,177.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	-
9	合计	54,241.31

5.11.4 报告期末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债券资产。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,491,778,943.00
本报告期基金总申购份额	132,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	92,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,531,778,943.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为2014年5月10日。

2.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告,指定媒体公告时间为2014年4月19日。

3.报告期内基金管理人对董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况进行公告,指定媒体公告时间为2014年4月12日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1069号)

《关于国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2013]814号)

《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基金合同》

《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托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

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2014年第二季度报告原文

9.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址:http://www.ubsdic.com

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

咨询电话:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

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联接基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银金融地产ETF联接
基金主代码	161211
交易代码	前端:161211 后端:161212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月9日
报告期末基金份额总额	1,487,224,169.01份
投资目标	本基金通过主要投资于目标ETF基金份额,力争实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
投资策略