

**国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告**

**2015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：中国银行股份有限公司**

**送出日期：2015年8月28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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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、利润分配等情况的说明	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	45
7.8 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	45
7.9 期末按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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	49
§11	备查文件目录 .....	50
11.1	备查文件目录 .....	50
11.2	存放地点 .....	51
11.3	查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银美丽中国混合
基金主代码	000663
基金运作方式	契约性开放式
基金合同生效日	2014年6月24日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,180,887,076.65份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>在有效控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，并精选美丽中国主题的相关上市公司股票进行投资，力争基金资产的持续稳健增值。</p>
投资策略	<p>本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡，精选美丽中国主题及其相关行业中的优质上市公司股票，力求实现基金资产的持续稳健增值。</p> <p>（一）类别资产配置</p> <p>本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。</p> <p>（二）股票投资管理</p> <p>本基金通过对美丽中国主题及其相关行业进行研究、精选，以及对相关行业的股票进行细致、深入的分析，秉承价值投资的理念，深入挖掘美丽中国主题及其相关行业股票的投资价值，分享美丽中国主题所带来的投资机会。</p> <p>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。</p>

	<p>(三) 债券投资管理</p> <p>本基金采取"自上而下"的债券分析方法, 确定债券投资组合, 并管理组合风险。在基本价值评估的基础上, 使用久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略等开展债券投资, 在不同的时期, 采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同, 具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金, 属于中高风险、中高收益的基金品种, 其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金, 低于股票型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯
	联系电话	400-880-6868
	电子邮箱	service@ubssdic.com
客户服务电话	400-880-6868	95566
传真	0755-82904048	010-66594942
注册地址	上海市虹口区东大名路638号7层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	518035	100818
法定代表人	叶柏寿	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告	<a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a>

正文的管理人互联网网址	
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

## § 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

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	52,778,697.61
本期利润	49,918,942.94
加权平均基金份额本期利润	0.1297
本期加权平均净值利润率	7.24%
本期基金份额净值增长率	93.98%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	1,451,802,430.00
期末可供分配基金份额利润	0.6657
期末基金资产净值	4,197,338,489.18
期末基金份额净值	1.925
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	108.92%

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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

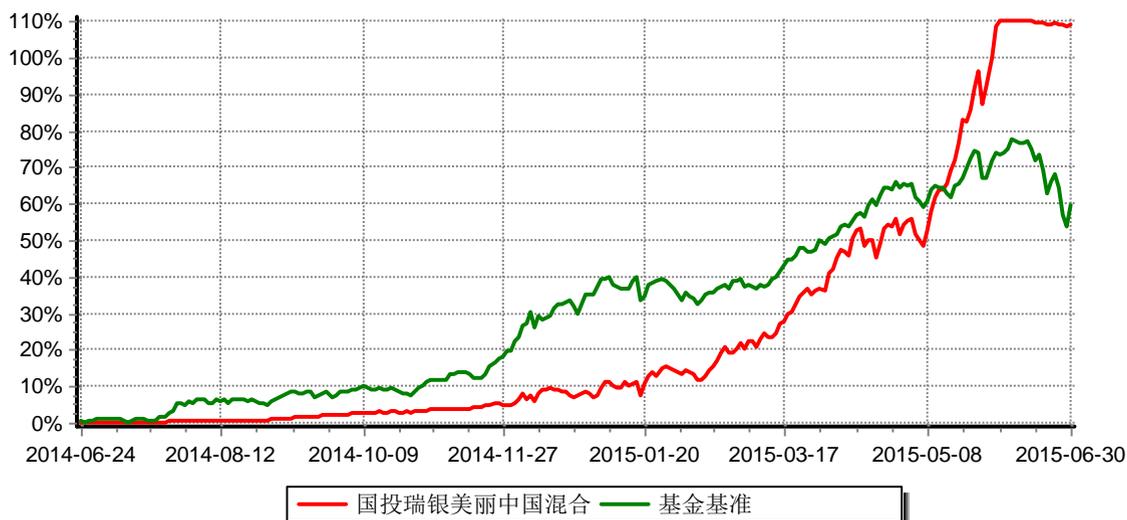
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.94%	1.30%	-4.37%	2.10%	13.31%	-0.80%
过去三个月	53.14%	1.84%	7.24%	1.57%	45.90%	0.27%
过去六个月	93.98%	1.55%	16.61%	1.36%	77.37%	0.19%
过去一年	108.92%	1.14%	58.37%	1.10%	50.55%	0.04%
自基金合同生效日起至今	108.92%	1.13%	59.76%	1.09%	49.16%	0.04%

注：1、本基金属于灵活配置混合型基金。在实际投资运作中，本基金的股票投资在基金资产中的占比将以基金股票配置比例范围0-95%的中间值，即约60%为基准，根据股市、债市等类别资产的预期风险与预期收益的综合比较与判断进行调整。为此，综合基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深300指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准，具体为沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

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：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。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，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）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。截止2015年6月底，在公募基金方面，公司共管理44只基金，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自2008年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自2006年开始为QFII和信托计划提供投资咨询服务，具有丰富经验，并于2007年获得QDII资格。

#### 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		
陈小玲	本基金基金经理、基金投资部副总监	2014年6月24日	—	10	中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商基金管理有限公司。2005年8月加入国投瑞银。现任国投瑞银策略精选基金、国投瑞银美丽中国基金和国投瑞银信息消费基金基金经理。
董晗	本基金基金经理	2014年11月22日	—	9	中国籍，硕士，具有基金从业资格。曾任职于易方达基金管理有限公司。2007年9月加入国投瑞银。

					曾任国投瑞银中证资源指数基金（LOF）基金经理，现任国投瑞银景气行业基金、国投瑞银美丽中国基金和国投瑞银创新动力基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银美丽中国灵活配置混合型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，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，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，形成了有效地公平交易体系。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%的交易情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年，宏观经济疲弱的格局不改。为了缓解经济的下行压力，央行继续沿用宽松的货币政策，再次采用降息降准等政策工具来缓解融资成本高企，维持低利率环境。流动性宽松、互联网信息浪潮冲击、改革转型预期下，中小创加速上涨，较大的透支了改革转型和经济复苏的预期。截至5月底，创业板市盈率155倍，中小板市盈率90倍左右，创业板85%以上的股票市盈率都在100倍以上，50倍以下的已经凤毛麟角，同时

产业资本在大量的减持，上半年创业板股东减持500多亿。清理场外配资成为了压垮骆驼的最后一根稻草，去杠杆带来的恐慌不断蔓延，投资者信心跌落到了谷底，踩踏事件频频发生。

市场结构上，金融、地产等大盘蓝筹股以及交运、养殖等周期复苏行业表现较好，而以TMT、医药等为代表的新兴行业，由于持股过于集中，调整过程中跌幅较大。

基金运作方面，本基金维持了较高股票仓位，并在6月份进行了较大幅度减仓，个股配置上超配环保、新能源、医药、消费类个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末（2015年6月30日），本基金份额净值为1.925元，本报告期份额净值增长率93.98%，同期业绩比较基准收益率为16.61%。基金净值增长高于业绩比较基准，主要原因在于及时减仓。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济有望呈现出阶段性企稳，主要是政府基建投资逐步发力带来的托底作用，但是考虑到相对疲弱的居民需求，通胀整体还将维持在温和可控的状态。在此背景下，预计货币政策整体保持相对宽松的格局，不排除年底出现再度宽松的可能。二季度证券市场伴随着去杠杆的压力出现了较大幅度的调整，但是未来有望在宽松格局下企稳回升。

本基金在下半年会有针对性增加权益仓位，更加关注企业的盈利增长和行业空间，把握市场情绪过度宣泄带来的建仓机会，控制基金净值的回撤空间。在投资方向上，依然围绕美丽中国相关行业进行选股。

#### 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，设立基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管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**

本基金本期已实现收益为52,778,697.61元，期末可供分配利润为1,451,802,430.00元。

本基金于2015年3月19日以2015年3月5日基金已实现的可分配收益为基准，实施收益分配8,573,667.88元，每10份基金份额分红1.02元。

报告期本基金的利润分配符合法律法规的相关规定和《基金合同》的约定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§ 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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### **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、利润分配等情况的说明**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,915,569,389.67	34,527,801.92
结算备付金		837,400.98	18,542,087.69
存出保证金		173,451.04	49,584.17
交易性金融资产	6.4.7.2	263,250,824.92	166,712,806.82
其中：股票投资		62,360,824.92	152,205,052.11
基金投资		—	—
债券投资		200,890,000.00	14,507,754.71
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	3,182,225.49	472,384.98
应收股利		—	—
应收申购款		24,474,521.26	51,405.80
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		4,207,487,813.36	220,356,071.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—

衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	15,729,525.38
应付赎回款		4,266,102.31	1,074,646.31
应付管理人报酬		4,430,435.82	335,300.38
应付托管费		738,405.98	55,883.43
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	532,413.12	908,428.19
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	181,966.95	124,050.19
负债合计		10,149,324.18	18,227,833.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,180,887,076.65	187,595,812.59
未分配利润	6.4.7.10	2,016,451,412.53	14,532,424.91
所有者权益合计		4,197,338,489.18	202,128,237.50
负债和所有者权益总计		4,207,487,813.36	220,356,071.38

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值人民币1.925元，基金份额总额2,180,887,076.65份。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年6月24日至2014年6月30日
一、收入		59,262,576.28	494,023.72
1.利息收入		4,380,033.96	494,023.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,850,941.05	494,023.72

债券利息收入		501,771.16	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		27,321.75	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,315,357.76	—
其中：股票投资收益	6.4.7.12	56,983,063.36	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	111,096.00	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	221,198.40	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,859,754.67	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	426,939.23	—
<b>减：二、费用</b>		9,343,633.34	242,883.48
1. 管理人报酬		5,164,006.50	203,900.66
2. 托管费		860,667.68	33,983.43
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	3,176,043.30	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	142,915.86	4,999.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		49,918,942.94	251,140.24

号填列)			
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,918,942.94	251,140.24

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6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)	187,595,812.59	14,532,424.91	202,128,237.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	49,918,942.94	49,918,942.94
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)	1,993,291,264.06	1,960,573,712.56	3,953,864,976.62
其中：1.基金申购款	2,159,688,626.70	2,006,316,336.83	4,166,004,963.53
2.基金赎回款	-166,397,362.64	-45,742,624.27	-212,139,986.91
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）	—	-8,573,667.88	-8,573,667.88
五、期末所有者权益（基金净值）	2,180,887,076.65	2,016,451,412.53	4,197,338,489.18
项 目	上年度可比期间 2014年6月24日至2014年6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)	—	—	—

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	251,140.24	251,140.24
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)	826,864,783.65	—	826,864,783.65
其中：1.基金申购款	826,864,783.65	—	826,864,783.65
2.基金赎回款	—	—	—
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)	826,864,783.65	251,140.24	827,115,923.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘纯亮

刘纯亮

冯伟

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]492号文《关于核准国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2014年6月24日正式生效,首次设立募集规模为826,864,783.65份基金份额。

本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但

须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%；投资于本基金定义的美丽中国主题相关的证券资产不低于基金非现金资产的80%；投资于权证的比例不超过基金资产的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：沪深300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的规定，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (2) 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

#### (3) 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，减按25%计入应纳税所得额。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	3,915,569,389.67
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	3,915,569,389.67

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	66,541,999.47	62,360,824.92	-4,181,174.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	201,123,800.00	200,890,000.00	-233,800.00
	合计	201,123,800.00	200,890,000.00	-233,800.00
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	267,665,799.47	263,250,824.92	-4,414,974.55	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,283,177.34
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	339.63
应收债券利息	1,891,792.35
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	191.87
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	6,724.30
合计	3,182,225.49

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	530,280.82
银行间市场应付交易费用	2,132.30
合计	532,413.12

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,037.03
信息披露费	149,177.14

审计费用	29,752.78
合计	181,966.95

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,595,812.59	187,595,812.59
本期申购	2,159,688,626.70	2,159,688,626.70
本期赎回（以“-”号填列）	-166,397,362.64	-166,397,362.64
本期末	2,180,887,076.65	2,180,887,076.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,614,455.58	-5,082,030.67	14,532,424.91
本期利润	52,778,697.61	-2,859,754.67	49,918,942.94
本期基金份额交易产生的变动数	1,387,982,944.69	572,590,767.87	1,960,573,712.56
其中：基金申购款	1,425,866,142.52	580,450,194.31	2,006,316,336.83
基金赎回款	-37,883,197.83	-7,859,426.44	-45,742,624.27
本期已分配利润	-8,573,667.88	—	-8,573,667.88
本期末	1,451,802,430.00	564,648,982.53	2,016,451,412.53

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	3,820,837.90
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	22,796.38

其他	7,306.77
合计	3,850,941.05

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	56,983,063.36
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	56,983,063.36

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,092,437,338.61
减：卖出股票成本总额	1,035,454,275.25
买卖股票差价收入	56,983,063.36

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	111,096.00
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—

合计	111,096.00
----	------------

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,186,081.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	14,513,475.78
减：应收利息总额	561,509.25
买卖债券差价收入	111,096.00

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	221,198.40
基金投资产生的股利收益	—
合计	221,198.40

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-2,859,754.67
——股票投资	-2,631,675.74
——债券投资	-228,078.93
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0

——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-2,859,754.67

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	395,898.66
转换费收入	31,040.57
合计	426,939.23

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	3,175,068.30
银行间市场交易费用	975.00
合计	3,176,043.30

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	99,177.14
银行汇划费用	13,785.94
账户维护费	—

其他费用	200.00
合计	142,915.86

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告送出日，本基金并无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

于2015年上半年度，并无与本基金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。

##### 6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年6月24日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,164,006.50	203,900.66
其中：支付销售机构的客户维	2,544,853.35	—

护费		
----	--	--

注：注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐累至月末按支付经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3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、公休等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年6月24日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	860,667.68	33,983.43

注：基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计算，逐累至月末按支付经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从支取。若遇法定节假日、公休等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年6月24日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,915,569,389.67	3,820,837.90	126,864,182.15	48,023.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份基金 份额分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形式 发放总额	利润分 配 合计	备注
1	2015-03-19		2015-3-19 (场 外)	1.020	7,266,058.00	1,307,609.88	8,573,667.88	
合计				1.020	7,266,058.00	1,307,609.88	8,573,667.88	

#### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：									
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受限 类型	认购 价格	期末估值 单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
300480	光力科技	2015-06-25	2015-07-02	新股未上市	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64
60383	四通	2015-06-23	2015-	新股未上	7.73	7.73	18,11	140,059.87	140,059.87

8	股份		07-01	市			9		
300487	蓝晓科技	2015-06-24	2015-07-02	新股未上市	14.83	14.83	10,700	158,681	158,681
300489	中飞股份	2015-06-24	2015-07-01	新股未上市	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64
300488	恒锋工具	2015-06-25	2015-07-01	新股未上市	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600277	亿利能源	2015-06-01	重大事项停牌	12.74		—	273,300	3,716,880.00	3,481,842.00
300096	易联众	2015-05-28	重大事项停牌	28.40		—	107,200	3,916,308.00	3,044,480.00
002310	东方园林	2015-05-27	重大事项停牌	28.57		—	96,700	3,671,272.09	2,762,719.00
000700	模塑科技	2015-04-15	重大事项停牌	28.41	2015-07-21	24.44	96,600	2,020,212.00	2,744,406.00
000630	铜陵有色	2015-03-09	筹划非公开发行股票停牌	10.32		—	255,800	2,176,165.00	2,639,856.00
002292	奥飞动漫	2015-05-18	筹划非公开发行股票停牌	37.29		—	2,988	73,786.32	111,422.52
300188	美亚柏科	2015-05-14	重大资产重组停牌	29.92		—	61,902	2,084,359.85	1,852,107.84

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收

益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、中期票据、债券回购、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款、协议存款、大额存单等）、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的规定）。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券市值的10%。

于2015年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例仅为0.00%，因此本基金无重大信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金对资金需求不能足额支付的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人持续进行本基金的流动性需求分析，构建投资组合时，对备选证券进行流动性检验，并以适度分散策略保持组合流动性，严格控制缺乏流动性资产的比例。同时通过独立的风险管理部门设定基金的流动性比例控制要求，对现金类资产配置策略、证券集中度、重仓证券的流动性以及冲击成本率、换手率和交易活跃度等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。于本期末，基金未持有流通受限的资产，所持资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人执行灵活的利率管理策略规避利率风险，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月 30日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	-----------	-------	------------	------	------	-----	----

资产							
银行存款	3,915,569,389.67	—	—				3,915,569,389.67
结算备付金	837,400.98	—	—				837,400.98
存出保证金	173,451.04	—	—				173,451.04
交易性金融资产		—	200,890,000.00			62,360,824.92	263,250,824.92
应收利息		—	—			3,182,225.49	3,182,225.49
应收申购款	695,172.04	—	—			23,779,349.22	24,474,521.26
资产总计	3,917,275,413.73	—	200,890,000.00	—	—	89,322,399.63	4,207,487,813.36
负债							
应付赎回款	—	—	—			4,266,102.31	4,266,102.31
应付管理人报酬	—	—	—			4,430,435.82	4,430,435.82
应付托管费	—	—	—			738,405.98	738,405.98
应付交易费用	—	—	—			532,413.12	532,413.12
其他负债	—	—	—			181,966.95	181,966.95
负债总计	—	—	—	—	—	10,149,324.18	10,149,324.18
利率敏感度缺口	3,917,275,413.73	—	200,890,000.00	—	—	79,173,075.45	4,197,338,489.18
上年度末 2014年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	34,527,801.92	—	—	—	—	—	34,527,801.92
结算备付金	18,542,087.69	—	—	—	—	—	18,542,087.69
存出保证金	49,584.17	—	—	—	—	—	49,584.17
交易性金融资产	—	1,196,837.20	13,025,940.00	284,977.51	—	152,205,052.11	166,712,806.82
应收利息	—	—	—	—	—	472,384.98	472,384.98
应收申购款	1,994.02	—	—	—	—	49,411.78	51,405.80
资产总计	53,121,467.80	1,196,837.20	13,025,940.00	284,977.51	—	152,726,848.87	220,356,071.38
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	15,729,525.38	15,729,525.38
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,074,646.31	1,074,646.31
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	335,300.38	335,300.38
应付托管费	—	—	—	—	—	55,883.43	55,883.43
应付交易费用	—	—	—	—	—	908,428.19	908,428.19
其他负债	—	—	—	—	—	124,050.19	124,050.19
负债总计	—	—	—	—	—	18,227,833.88	18,227,833.88
利率敏感度缺口	53,121,467.80	1,196,837.20	13,025,940.00	284,977.51	—	134,499,014.99	202,128,237.50

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于2015年6月30日持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值4.79%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	62,360,824.92	1.49	152,205,052.11	75.30
交易性金融资产-债券投资	200,890,000.00	4.79	14,507,754.71	7.18
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	263,250,824.92	6.27	166,712,806.82	82.48

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	基金业绩比较基准增加 5%	142,777,806.88	2,595,126.85
	基金业绩比较基准减少 5%	-142,777,806.88	-2,595,126.85

注：基金业绩比较基准=60%×沪深300指数+40%×中债总指数。

#### 6.4.14 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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	62,360,824.92	1.48
	其中：股票	62,360,824.92	1.48
2	固定收益投资	200,890,000.00	4.77
	其中：债券	200,890,000.00	4.77
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金	—	—

	融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	3,916,406,790.65	93.08
7	其他各项资产	27,830,197.79	0.66
8	合计	4,207,487,813.36	100.00

## 7.2 报告期末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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	484,279.65	0.01
B	采矿业	—	—
C	制造业	39,486,404.74	0.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,280,505.92	0.08
F	批发和零售业	4,135,677.55	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	225,347.22	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,896,587.84	0.12
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	3,924,037.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	5,927,985.00	0.14
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	—	—
	合计	62,360,824.92	1.49

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300070	碧水源	121,500	5,927,985.00	0.14
2	600315	上海家化	128,600	5,581,240.00	0.13
3	002594	比亚迪	97,445	5,381,887.35	0.13
4	000028	国药一致	55,505	4,135,677.55	0.10
5	600420	现代制药	92,000	4,002,000.00	0.10
6	002344	海宁皮城	199,900	3,924,037.00	0.09
7	002510	天汽模	254,802	3,885,730.50	0.09
8	300137	先河环保	161,700	3,699,696.00	0.09
9	002456	欧菲光	104,400	3,522,456.00	0.08
10	600277	亿利能源	273,300	3,481,842.00	0.08
11	300096	易联众	107,200	3,044,480.00	0.07
12	002310	东方园林	96,700	2,762,719.00	0.07
13	000700	模塑科技	96,600	2,744,406.00	0.07
14	000630	铜陵有色	255,800	2,639,856.00	0.06
15	300188	美亚柏科	61,902	1,852,107.84	0.04
16	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.04
17	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.03
18	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.01
19	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.01
20	002770	科迪乳业	40,555	399,872.30	0.01
21	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.01
22	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	—
23	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	—
24	300481	濮阳惠成	11,296	148,542.40	—
25	603838	四通股份	18,119	140,059.87	—
26	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	—
27	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	—
28	603085	天成自控	11,690	122,394.30	—
29	002292	奥飞动漫	2,988	111,422.52	—

30	300480	光力科技	7,263	52,874.64	—
----	--------	------	-------	-----------	---

## 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	600837	海通证券	16,409,867.49	8.12
2	601318	中国平安	14,707,915.20	7.28
3	600000	浦发银行	13,784,569.27	6.82
4	600885	宏发股份	13,255,922.91	6.56
5	000028	国药一致	12,480,744.76	6.17
6	300207	欣旺达	12,303,450.88	6.09
7	002074	东源电器	11,888,183.80	5.88
8	300037	新宙邦	11,538,976.26	5.71
9	601166	兴业银行	11,501,574.18	5.69
10	002052	同洲电子	11,111,956.06	5.50
11	600392	盛和资源	10,248,251.98	5.07
12	002456	欧菲光	9,899,471.00	4.90
13	600686	金龙汽车	9,567,606.79	4.73
14	600594	益佰制药	8,811,615.50	4.36
15	601377	兴业证券	8,596,025.86	4.25
16	000800	一汽轿车	8,497,209.13	4.20
17	002714	牧原股份	8,481,406.02	4.20
18	002496	辉丰股份	8,478,307.00	4.19
19	000932	华菱钢铁	8,471,450.04	4.19
20	000732	泰禾集团	8,086,680.26	4.00
21	002344	海宁皮城	8,036,834.00	3.98
22	002594	比亚迪	7,926,711.80	3.92
23	002108	沧州明珠	7,515,204.66	3.72
24	600277	亿利能源	7,346,064.00	3.63

25	600259	广晟有色	7,326,061.00	3.62
26	002215	诺普信	7,190,580.52	3.56
27	300070	碧水源	6,997,260.00	3.46
28	600420	现代制药	6,986,746.00	3.46
29	600048	保利地产	6,892,220.00	3.41
30	000733	振华科技	6,545,970.50	3.24
31	300170	汉得信息	6,458,665.25	3.20
32	600765	中航重机	6,411,175.56	3.17
33	000061	农产品	6,286,820.00	3.11
34	601939	建设银行	6,193,784.80	3.06
35	600469	风神股份	6,183,806.99	3.06
36	002121	科陆电子	6,112,426.55	3.02
37	000024	招商地产	6,055,690.00	3.00
38	002299	圣农发展	6,055,109.75	3.00
39	000831	五矿稀土	6,048,213.34	2.99
40	002385	大北农	6,025,132.20	2.98
41	600315	上海家化	5,996,189.43	2.97
42	600820	隧道股份	5,789,549.11	2.86
43	000700	模塑科技	5,783,582.00	2.86
44	002712	思美传媒	5,702,390.20	2.82
45	300284	苏交科	5,625,834.29	2.78
46	600754	锦江股份	5,504,280.05	2.72
47	600979	广安爱众	5,424,722.79	2.68
48	601877	正泰电器	5,400,117.40	2.67
49	002681	奋达科技	5,375,003.00	2.66
50	002556	辉隆股份	5,370,638.38	2.66
51	600038	中直股份	5,262,205.36	2.60
52	300376	易事特	5,106,698.00	2.53
53	002358	森源电气	5,059,355.18	2.50
54	601567	三星电气	5,028,778.16	2.49

55	002510	天汽模	5,026,551.98	2.49
56	002157	正邦科技	4,940,848.20	2.44
57	600143	金发科技	4,867,717.41	2.41
58	600685	中船防务	4,851,525.00	2.40
59	000060	中金岭南	4,803,974.10	2.38
60	002284	亚太股份	4,762,517.28	2.36
61	300210	森远股份	4,735,710.37	2.34
62	002024	苏宁云商	4,734,963.00	2.34
63	000712	锦龙股份	4,715,298.92	2.33
64	000768	中航飞机	4,712,136.00	2.33
65	000958	东方能源	4,704,796.47	2.33
66	600805	悦达投资	4,677,120.00	2.31
67	300137	先河环保	4,497,541.00	2.23
68	300101	振芯科技	4,468,014.66	2.21
69	600182	S佳通	4,402,860.00	2.18
70	000590	*ST古汉	4,396,782.28	2.18
71	002081	金螳螂	4,374,969.72	2.16
72	300115	长盈精密	4,371,113.00	2.16
73	000927	*ST夏利	4,363,652.00	2.16
74	600096	云天化	4,218,843.20	2.09
75	600438	通威股份	4,211,723.00	2.08
76	002256	彩虹精化	4,176,335.40	2.07
77	002217	合力泰	4,140,541.00	2.05

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	21,238,141.59	10.51
2	600885	宏发股份	16,909,081.68	8.37

3	600837	海通证券	16,616,194.30	8.22
4	600000	浦发银行	13,722,815.37	6.79
5	600392	盛和资源	13,620,510.31	6.74
6	300207	欣旺达	13,439,718.22	6.65
7	002074	东源电器	13,308,789.60	6.58
8	000800	一汽轿车	13,294,469.27	6.58
9	300037	新宙邦	12,297,971.13	6.08
10	002052	同洲电子	11,679,037.47	5.78
11	601166	兴业银行	11,181,662.00	5.53
12	600686	金龙汽车	10,728,565.63	5.31
13	600594	益佰制药	10,144,281.80	5.02
14	000061	农产品	10,003,683.07	4.95
15	002714	牧原股份	9,906,724.73	4.90
16	300203	聚光科技	9,377,735.28	4.64
17	000028	国药一致	8,976,490.77	4.44
18	000831	五矿稀土	8,947,846.57	4.43
19	002496	辉丰股份	8,868,008.92	4.39
20	600315	上海家化	8,828,542.22	4.37
21	002215	诺普信	8,740,901.52	4.32
22	601377	兴业证券	8,671,605.25	4.29
23	000732	泰禾集团	8,597,244.41	4.25
24	002108	沧州明珠	8,351,868.64	4.13
25	000932	华菱钢铁	8,262,775.80	4.09
26	601567	三星电气	8,196,775.02	4.06
27	601877	正泰电器	7,957,478.20	3.94
28	300170	汉得信息	7,733,406.40	3.83
29	002121	科陆电子	7,663,000.51	3.79
30	002385	大北农	7,535,854.27	3.73
31	002544	杰赛科技	7,494,483.11	3.71
32	000902	新洋丰	7,410,854.70	3.67

33	000958	东方能源	7,301,045.00	3.61
34	000733	振华科技	7,139,700.62	3.53
35	600438	通威股份	7,071,384.33	3.50
36	600259	广晟有色	7,054,430.98	3.49
37	600461	洪城水业	6,940,648.25	3.43
38	600820	隧道股份	6,905,328.72	3.42
39	300284	苏交科	6,875,928.43	3.40
40	002556	辉隆股份	6,796,898.95	3.36
41	600048	保利地产	6,747,618.98	3.34
42	000927	*ST夏利	6,619,536.27	3.27
43	600765	中航重机	6,565,316.77	3.25
44	601777	力帆股份	6,492,081.79	3.21
45	002299	圣农发展	6,472,765.59	3.20
46	002284	亚太股份	6,371,349.00	3.15
47	600038	中直股份	6,281,177.60	3.11
48	002217	合力泰	6,272,176.37	3.10
49	600469	风神股份	6,037,297.00	2.99
50	601939	建设银行	6,006,917.80	2.97
51	002157	正邦科技	6,005,256.09	2.97
52	600979	广安爱众	5,937,532.00	2.94
53	002712	思美传媒	5,903,357.47	2.92
54	002456	欧菲光	5,886,571.41	2.91
55	000024	招商地产	5,835,361.00	2.89
56	002681	奋达科技	5,749,203.41	2.84
57	000596	古井贡酒	5,684,687.00	2.81
58	000400	许继电气	5,676,855.37	2.81
59	600280	中央商场	5,635,008.56	2.79
60	600335	国机汽车	5,536,896.31	2.74
61	000712	锦龙股份	5,530,560.00	2.74
62	002256	彩虹精化	5,509,483.62	2.73

63	002358	森源电气	5,498,539.06	2.72
64	002007	华兰生物	5,496,501.06	2.72
65	600176	中国巨石	5,458,314.83	2.70
66	300376	易事特	5,370,992.00	2.66
67	000915	山大华特	5,196,719.42	2.57
68	000768	中航飞机	5,170,132.25	2.56
69	600182	S佳通	5,162,482.62	2.55
70	300070	碧水源	5,107,362.42	2.53
71	601888	中国国旅	5,070,713.91	2.51
72	600754	锦江股份	5,037,388.75	2.49
73	601233	桐昆股份	5,031,364.82	2.49
74	000590	*ST古汉	5,027,581.48	2.49
75	300027	华谊兄弟	5,006,964.00	2.48
76	300210	森远股份	4,981,560.55	2.46
77	600562	国睿科技	4,959,767.41	2.45
78	600729	重庆百货	4,910,164.40	2.43
79	000060	中金岭南	4,834,663.86	2.39
80	000786	北新建材	4,832,679.77	2.39
81	300101	振芯科技	4,817,714.20	2.38
82	600143	金发科技	4,796,802.54	2.37
83	600702	沱牌舍得	4,715,761.48	2.33
84	600685	中船防务	4,683,634.00	2.32
85	002024	苏宁云商	4,671,854.03	2.31
86	002081	金螳螂	4,636,217.63	2.29
87	600993	马应龙	4,613,721.00	2.28
88	002426	胜利精密	4,601,410.68	2.28
89	600096	云天化	4,598,403.82	2.27
90	600566	济川药业	4,552,476.72	2.25
91	300115	长盈精密	4,432,469.00	2.19
92	002736	国信证券	4,355,912.00	2.16

93	002431	棕榈园林	4,324,859.81	2.14
94	600805	悦达投资	4,281,002.00	2.12
95	002465	海格通信	4,150,977.10	2.05
96	000700	模塑科技	4,146,435.76	2.05
97	002466	天齐锂业	4,051,086.29	2.00

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	948,241,723.80
卖出股票的收入（成交）总额	1,092,437,338.61

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	200,890,000.00	4.79
	其中：政策性金融债	200,890,000.00	4.79
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	200,890,000.00	4.79

### 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

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	150202	15国开02	1,000,000	100,540,000.00	2.40
2	150211	15国开11	1,000,000	100,350,000.00	2.39

### 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

本基金本期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按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

本基金本期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，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进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中，持有"上海家化"市值5,581,240.00元，占基金资产净值0.13%；根据上海家化联合股份有限公司2015年6月13日公告，该公司由于信息披露违法违规，被上海证监局依法处以行政处罚，其中，该公司被予以警告并处以30万元罚款，葛文耀等直接责任人员分别被予以警告和处以罚款。基金管理人认为，该公司上述涉及信息披露违规事项主要发生在2008年和2009年，公司当前总体生产经营和财务状况保持稳定，事件对该公司经营活动未产生实质性影响，不改变该公司基本面。

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。

7.12.2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。

### 7.12.3 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	173,451.04
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,182,225.49
5	应收申购款	24,474,521.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,830,197.79

### 7.12.4 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可转换债券。

### 7.12.5 期末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	600277	亿利能源	3,481,842.00	0.08	筹划重大事项 停牌

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
5,688	383,418.97	2,079,335,990.5 8	95.34%	101,551,086.07	4.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基 金	1,209,128.40	0.06%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年6月24日)基金份额总额	826,864,783.65
本报告期期初基金份额总额	187,595,812.59
本报告期基金总申购份额	2,159,688,626.70
减：本报告期基金总赎回份额	166,397,362.64
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	2,180,887,076.65

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门托管部门的重大人事变动如下：

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金基金投资策略未发生变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金继续聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，未发生改聘会计师事务所的情况。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	754,138,299.32	37.03%	686,568.65	37.03%	0.3703
招商证券	1	549,826,762.26	27%	500,561.41	27%	0.27
申万宏源证券	1	153,683,078.19	7.55%	139,913.66	7.55%	0.0755
国信证券	1	152,614,	7.49%	138,940.76	7.49%	0.0749

		937.22				
中投证券	1	135,618,925.59	6.66%	123,467.79	6.66%	0.0666
广州证券	1	123,266,645.1	6.05%	112,222.48	6.05%	0.0605
东北证券	1	52,189,451.01	2.56%	47,512.86	2.56%	0.0256
中金公司	1	35,960,485.59	1.77%	32,738.17	1.77%	0.0177
安信证券	1	32,152,734.96	1.58%	29,272.16	1.58%	0.0158
中信建投	1	25,433,059.95	1.25%	23,153.68	1.25%	0.0125
银河证券	1	16,017,056.5	0.79%	14,581.96	0.79%	0.0079
中信证券	1	5,865,826.9	0.29%	5,340.26	0.29%	0.0029

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
招商证券	3,426,590.49	100%	17,000,000	100%	—	—

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本报告期内本基金未发生交易所权证交易。

3、本报告期本基金新增租用中信证券2个交易单元，新增租用申万宏源证券、中信建投证券、东北证券、安信证券、联讯证券以及银河证券各1个交易单元。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于本基金持有的通威股份和大北农进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-03-05
2	关于本基金分红的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-03-17
3	关于本基金持有的太极集团进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-03-21
4	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-03-31
5	关于本基金持有的铜陵有色进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-04-23
6	关于本基金持有的模塑科技进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-04-24
7	关于本基金持有的三星电气进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-05-09
8	关于本基金持有的美亚柏科进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-05-22
9	关于网上直销转账汇款买基金减免认、申购费的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-06-01
10	关于本基金持有的比亚迪、奥飞动漫、新洋丰、易联众、邦讯科技和亿利能源进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-06-03
11	关于本基金持有的东方园林进行估值调整的公告	《证券时报》 《上海证券报》	2015-06-27

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可

[2014]492号)

《关于国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（证券投资基金机构监管部部函[2014]602号）

《国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银美丽中国灵活配置混合型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

国投瑞银美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告原文

## 11.2 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.ubssdic.com>

## 11.3 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：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日