

**国投瑞银新回报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：招商银行股份有限公司**

**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。

基金托管人招商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03月20日（基金合同生效日）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	11
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	12
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
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	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46

10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	47
§11	备查文件目录.....	48
11.1	备查文件目录.....	48
11.2	存放地点.....	48
11.3	查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国投瑞银新回报混合
基金主代码	001119
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月20日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,309,593,604.77份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益平衡。精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金产长期稳定增长。</p> <p>1、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>2、股票投资管理</p> <p>本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中，基金人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对配置进持续动态地调整。</p> <p>本基金根据定量与定性分析确定股票初选库；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，运用现金流贴现</p>

	<p>模型等估值方法分析股票内在价值；结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。</p> <p>3、债券投资管理 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。</p> <p>4、衍生品投资策略 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、国债期货等金融衍生品。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
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	招商银行股份有限公司
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	《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
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年3月20日至2015年6月30日）
本期已实现收益	116,026,739.55
本期利润	159,483,697.49
加权平均基金份额本期利润	0.0369
本期加权平均净值利润率	3.61%
本期基金份额净值增长率	3.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	135,399,979.86
期末可供分配基金份额利润	0.0185
期末基金资产净值	7,583,782,908.67
期末基金份额净值	1.038
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.80%

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

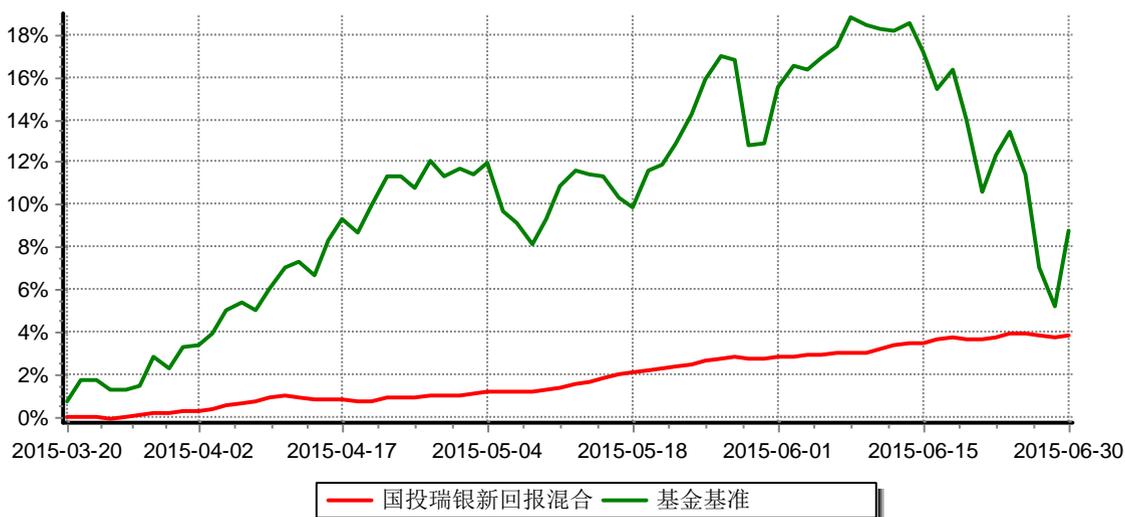
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.07%	0.09%	-3.61%	1.74%	4.68%	-1.65%
过去三个月	3.59%	0.08%	6.34%	1.31%	-2.75%	-1.23%
自基金合同生效日起至今	3.80%	0.08%	8.77%	1.25%	-4.97%	-1.17%

注：1、沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。综合考虑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。

2、本基金基金合同生效日为2015年03月20日，截至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

### 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：1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至本报告期末，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。

2、本基金基金合同生效日为2015年3月20日，截至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。

## § 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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
桑俊	本基金基金经理	2015年3月20日	—	7	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职国海证券研究所。2012年5月加入国投瑞银。现任国投瑞银新机遇灵活配置混合基金、国投瑞银新动力灵活配置混合基金、国投瑞银瑞利灵活配置混合基金、国投瑞银新回报灵活配置混合基金和国投瑞银精选收益灵活配置混合型基金经理。

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合规守信情况的说明

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《国投瑞银新回报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

进入2015年以来，宏观经济疲弱的格局不改。房地产市场的调整延续，虽然商品房销售量有所好转，但是高库存背景下房地产企业土地购置意愿较弱，导致房地产投资活动依然低迷。地方政府债务的规范和非标业务清理约束了地方政府投资能力。房地产和基建投资的疲弱使得全社会总需求持续维持低水平，体现为不断回落的工业品价格和持续降低的进口增速。为了缓解经济的下行压力，央行在上半年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。

管理层在宏观经济放缓的大背景下，不断加大政策力度，推出地方政府债务置换提高地方政府投资能力，加快基础设施建设缓解投资下行压力，增加对服务业、自主创新等领域的政策支持增加就业水平。同时，加快改革转型的力度，国企改革混合所有制改革不断破冰。

流动性宽松、互联网信息浪潮冲击、改革转型预期下，上半年市场率先冲高，以TMT、军工为代表的高新技术产业超额收益明显。但是伴随着证监会清理场外融资，股票市场去杠杆，导致上半年末市场出现了系统性的下跌，以中小市值为代表的成长性行业和公司跌幅居前。

伴随着流动性的变化，本基金采取了相对灵活的应对策略，以新股IPO为主要的投资方向，维持较低仓位，灵活应对。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额净值为1.038元，净值增长率为3.80%，同期业绩比较基准收益率为8.77%，基金净值增长率低于业绩基准，主要由于本基金主要进行了新股配置，维持较低的权益类资产配置。

## 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。6月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控制权益仓位，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，为持有人创造收益。

#### 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116,026,739.55元，期末可供分配利润为135,399,979.86元。本基金本期未实行利润分配。

#### 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，招商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国投瑞银新回报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合规守信、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：国投瑞银新回报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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	4,565,537,191.21
结算备付金		278,934.68
存出保证金		85,752.39
交易性金融资产	6.4.7.2	525,200,713.13
其中：股票投资		141,423,811.41
基金投资		—
债券投资		383,776,901.72
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	2,492,472,399.70

应收证券清算款		21,992,095.89
应收利息	6.4.7.5	5,598,461.12
应收股利		—
应收申购款		1,191,626.99
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		7,612,357,175.11
<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>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		—
应付赎回款		17,396,902.61
应付管理人报酬		9,176,167.03
应付托管费		1,529,361.20
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	358,878.64
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	112,956.96
负债合计		28,574,266.44
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	7,309,593,604.77
未分配利润	6.4.7.10	274,189,303.90

所有者权益合计		7,583,782,908.67
负债和所有者权益总计		7,612,357,175.11

注：1.报告截止日2015年6月30日，基金份额净值人民币1.038元，基金份额总额7,309,593,604.77份。  
2.本基金合同生效日为2015年3月20日，2015年半年度实际报告期间为2015年3月20日至2015年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年3月20日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年3月20日至2015年6月30日
一、收入		182,284,024.31
1.利息收入		15,974,923.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,417,988.30
债券利息收入		1,327,783.69
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		3,229,151.98
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		120,860,160.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	120,335,736.74
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	177,178.74
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	347,245.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	43,456,957.94
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	1,991,981.78
<b>减：二、费用</b>		22,800,326.82
1. 管理人报酬		18,651,546.87
2. 托管费		3,108,591.16
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	876,955.71
5. 利息支出		75,294.52
其中：卖出回购金融资产支出		75,294.52
6. 其他费用	6.4.7.19	87,938.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		159,483,697.49
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		159,483,697.49

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年3月20日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2015年3月20日（合同生效日）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)	2,000,475,963.93	—	2,000,475,963.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	159,483,697.49	159,483,697.49
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）	5,309,117,640.84	114,705,606.41	5,423,823,247.25
其中：1.基金申购款	5,814,974,483.54	127,156,422.73	5,942,130,906.27

2.基金赎回款	-505,856,842.70	-12,450,816.32	-518,307,659.02
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）	7,309,593,604.77	274,189,303.90	7,583,782,908.67

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

国投瑞银新回报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[2015]286号文《关于核准国投瑞银新回报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2015年3月20日正式生效，首次设立募集规模为2,000,475,963.93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，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

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、资产支持证券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、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）。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50%。

### 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03月20日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年3月20日（基金合同生效日）起至2015年6月30日止。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

人民币

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### **(1)金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

#### (2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划

以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由

上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为1次，最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **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	4,565,537,191.21
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	4,565,537,191.21

### 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		97,423,033.47	141,423,811.41	44,000,777.94
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	1,120,901.72	1,120,901.72	—
	银行间市场	383,199,820.00	382,656,000.00	-543,820.00
	合计	384,320,721.72	383,776,901.72	-543,820.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		481,743,755.19	525,200,713.13	43,456,957.94

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	2,492,472,399.70	—
合计	2,492,472,399.70	

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	750,519.22
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	125.60
应收债券利息	3,391,874.37
应收买入返售证券利息	1,233,460.59
应收申购款利息	207,587.80
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	14,893.54
合计	5,598,461.12

#### 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	323,255.85
银行间市场应付交易费用	35,622.79
合计	358,878.64

#### 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	41,179.35
信息披露费	32,299.77
审计费用	39,477.84
合计	112,956.96

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年3月20日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,000,475,963.93	2,000,475,963.93
本期申购	5,814,974,483.54	5,814,974,483.54
本期赎回（以“-”号填列）	-505,856,842.70	-505,856,842.70
本期末	7,309,593,604.77	7,309,593,604.77

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	—	—	—
本期利润	116,026,739.55	43,456,957.94	159,483,697.49
本期基金份额交易产生的变动数	19,373,240.31	95,332,366.10	114,705,606.41

其中：基金申购款	22,279,766.39	104,876,656.34	127,156,422.73
基金赎回款	-2,906,526.08	-9,544,290.24	-12,450,816.32
本期已分配利润	—	—	—
本期末	135,399,979.86	138,789,324.04	274,189,303.90

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年3月20日至2015年6月30日
活期存款利息收入	5,068,473.75
定期存款利息收入	6,106,250.00
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	20,550.38
其他	222,714.17
合计	11,417,988.30

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月20日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	311,396,181.80
减：卖出股票成本总额	191,060,445.06
买卖股票差价收入	120,335,736.74

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月20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	757,211.80
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	579,984.75

减：应收利息总额	48.31
买卖债券差价收入	177,178.74

#### 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3月20日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	347,245.14
基金投资产生的股利收益	—
合计	347,245.14

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月20日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	43,456,957.94
——股票投资	44,000,777.94
——债券投资	-543,820.00
——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	43,456,957.94

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月20日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,911,899.95
转换费收入	80,081.83
合计	1,991,981.78

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月20日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	875,105.71
银行间市场交易费用	1,850.00
合计	876,955.71

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月20日至2015年6月30日
审计费用	39,477.84
信息披露费	32,299.77
银行汇划费用	15,760.95
账户维护费	—
其他费用	400.00
合计	87,938.56

### 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
招商银行股份有限公司	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。

##### 6.4.10.1.1 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2015年3月20日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商银行	50,551,000.00	13.19%

##### 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3月20日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,651,546.87
其中：支付销售机构的客户维护费	5,220,341.30

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3月20日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,108,591.16

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

##### 6.4.10.3.1 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015年3月20日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商银行	50,551,000.00	13.19%

#### 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3月20日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,565,537,191.21	5,068,473.75

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金于本报告期内未进行利润分配。

#### 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：股票									
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
603085	天成自控	2015-06-24	2015-07-08	认购新发	7.27	10.47	11,690	84,986.3	122,394.3
300480	光力科技	2015-06-25	2015-07-02	认购新发	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64
603838	四通股份	2015-06-23	2015-07-01	认购新发	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87
300487	蓝晓科技	2015-06-24	2015-07-02	认购新发	14.83	14.83	10,700	158,681	158,681
300489	中飞股份	2015-06-24	2015-07-01	认购新发	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64
300488	恒锋工具	2015-06-25	2015-07-01	认购新发	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74
300463	迈克	2015-05-21	2016-05-30	新股锁	27.96	87.76	233,333	6,523,990.68	20,477,304.08

	生物			定					
300436	广生堂	2015-04-16	2016-04-22	新股锁定	21.47	149.39	47,297	1,015,466.59	7,065,698.83
300443	金雷风电	2015-04-16	2016-04-22	新股锁定	31.94	145.98	65,566	2,094,178.04	9,571,324.68

#### 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
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项停牌	36.43		—	385,200	10,994,634.45	14,032,836.00
300467	迅游科技	2015-06-25	重大事项停牌	297.30	2015-07-02	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80

#### 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0.0148%，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	4,565,537,191.21	—	—	—	—	—	4,565,537,191.21
结算备付金	278,934.68	—	—	—	—	—	278,934.68
存出保证金	85,752.39	—	—	—	—	—	85,752.39
交易性金融资产	—	—	382,656,000.00	1,120,901.72	—	141,423,811.41	525,200,713.13
买入返售金融资产	2,492,472,399.70	—	—	—	—	—	2,492,472,399.70

应收证券清算款	—	—	—	—	—	21,992,095.89	21,992,095.89
应收利息	—	—	—	—	—	5,598,461.12	5,598,461.12
应收申购款	241,874.38	—	—	—	—	949,752.61	1,191,626.99
资产总计	7,058,616,152.36	—	382,656,000.00	1,120,901.72	—	169,964,121.03	7,612,357,175.11
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	17,396,902.61	17,396,902.61
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	9,176,167.03	9,176,167.03
应付托管费	—	—	—	—	—	1,529,361.20	1,529,361.20
应付交易费用	—	—	—	—	—	358,878.64	358,878.64
其他负债	—	—	—	—	—	112,956.96	112,956.96
负债总计	—	—	—	—	—	28,574,266.44	28,574,266.44
利率敏感度缺口	7,058,616,152.36	—	382,656,000.00	1,120,901.72	—	141,389,854.59	7,583,782,908.67

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.06%，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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	141,423,811.41	1.86
交易性金融资产-债券投资	383,776,901.72	5.06
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	525,200,713.13	6.93

#### 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
	基金业绩比较基准增加5%	11,709,214.89
	基金业绩比较基准减少5%	-11,709,214.89

注：基金业绩比较基准 = 沪深300 指数收益率 × 50% + 中债综合指数收益率 × 50%

#### 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	141,423,811.41	1.86
	其中：股票	141,423,811.41	1.86
2	固定收益投资	383,776,901.72	5.04
	其中：债券	383,776,901.72	5.04
	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	2,492,472,399.70	32.74
	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	4,565,816,125.89	59.98
7	其他各项资产	28,867,936.39	0.38
8	合计	7,612,357,175.11	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	1,635,059.25	0.02
C	制造业	92,373,225.70	1.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,380,310.40	0.15
E	建筑业	517,786.92	0.01
F	批发和零售业	18,520,949.34	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	225,347.22	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,410,100.44	0.02
J	金融业	—	—
K	房地产业	14,032,836.00	0.19
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	843,916.49	0.01
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	—	—
	合计	141,423,811.41	1.86

### 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	000999	华润三九	754,100	22,917,099.00	0.30
2	300463	迈克生物	233,333	20,477,304.08	0.27
3	000028	国药一致	237,234	17,676,305.34	0.23
4	600420	现代制药	379,840	16,523,040.00	0.22
5	000024	招商地产	385,200	14,032,836.00	0.19

6	601985	中国核电	870,720	11,380,310.40	0.15
7	002056	横店东磁	350,750	10,971,460.00	0.14
8	300443	金雷风电	65,566	9,571,324.68	0.13
9	300436	广生堂	47,297	7,065,698.83	0.09
10	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.02
11	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.02
12	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.02
13	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01
14	603108	润达医疗	11,800	844,644.00	0.01
15	300404	博济医药	8,131	843,916.49	0.01
16	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.01
17	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.01
18	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.01
19	002770	N科迪	40,555	399,872.30	0.01
20	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.00
21	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.00
22	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.00
23	300483	N沃施	9,356	153,438.40	0.00
24	300481	N惠成	11,296	148,542.40	0.00
25	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.00
26	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.00
27	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
28	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.00
29	300480	光力科技	7,263	52,874.64	0.00

## 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	000999	华润三九	25,851,287.65	0.34%
2	600420	现代制药	23,751,420.00	0.31%
3	601985	中国核电	23,614,468.80	0.31%
4	000028	国药一致	20,025,884.99	0.26%
5	600315	上海家化	19,998,090.58	0.26%
6	002056	横店东磁	14,692,007.96	0.19%
7	000024	招商地产	10,994,634.45	0.14%
8	600686	金龙汽车	10,062,306.96	0.13%
9	002736	国信证券	10,049,490.00	0.13%
10	601788	光大证券	10,049,200.20	0.13%
11	000709	河北钢铁	10,032,385.48	0.13%
12	601877	正泰电器	10,020,671.07	0.13%
13	601166	兴业银行	10,019,000.00	0.13%
14	601398	工商银行	9,999,840.00	0.13%
15	000002	万 科 A	9,999,559.40	0.13%
16	600010	包钢股份	9,999,511.60	0.13%
17	600550	保变电气	9,999,033.66	0.13%
18	000582	北部湾港	9,998,835.00	0.13%
19	300463	迈克生物	6,523,990.68	0.09%
20	603003	龙宇燃油	5,743,242.96	0.08%

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601985	中国核电	83,186,714.00	1.10%
2	600315	上海家化	20,199,950.26	0.27%
3	002736	国信证券	12,035,353.00	0.16%
4	601788	光大证券	11,288,971.74	0.15%

5	600420	现代制药	11,196,604.00	0.15%
6	601166	兴业银行	11,185,500.00	0.15%
7	000582	北部湾港	10,788,959.46	0.14%
8	000709	河北钢铁	10,712,962.06	0.14%
9	601877	正泰电器	10,453,084.19	0.14%
10	600550	保变电气	10,015,403.12	0.13%
11	601398	工商银行	9,922,708.00	0.13%
12	000002	万科A	9,908,692.00	0.13%
13	600010	包钢股份	9,772,945.76	0.13%
14	600686	金龙汽车	9,468,028.00	0.12%
15	000028	国药一致	7,641,243.69	0.10%
16	603789	星光农机	6,899,043.00	0.09%
17	601225	陕西煤业	6,235,003.00	0.08%
18	603808	歌力思	5,099,812.80	0.07%
19	603003	龙宇燃油	4,820,488.66	0.06%
20	000906	物产中拓	4,105,971.56	0.05%

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	288,483,478.53
卖出股票的收入（成交）总额	311,396,181.80

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	382,656,000.00	5.05

	其中：政策性金融债	382,656,000.00	5.05
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	1,120,901.72	0.01
8	其他	—	—
9	合计	383,776,901.72	5.06

## 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	150206	15国开06	1,800,000	181,656,000.00	2.40
2	150403	15农发03	1,000,000	100,610,000.00	1.33
3	150411	15农发11	500,000	50,215,000.00	0.66
4	150211	15国开11	500,000	50,175,000.00	0.66
5	132002	15天集EB	11,210	1,120,901.72	0.01

## 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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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，适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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	85,752.39
2	应收证券清算款	21,992,095.89
3	应收股利	—
4	应收利息	5,598,461.12
5	应收申购款	1,191,626.99
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	28,867,936.39

### 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处于转股期的可转换债券。

### 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	300463	迈克生物	20,477,304.08	0.27	新股锁定
2	000024	招商地产	14,032,836.00	0.19	重大事项停牌
3	300443	金雷风电	9,571,324.68	0.13	新股锁定
4	300436	广生堂	7,065,698.83	0.09	新股锁定

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本期末投资托管行股票、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
10,061	726,527.54	5,799,519,428.78	79.34%	1,510,074,175.99	20.66%

### 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	557,446.35	0.01%

### 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	0

究部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年3月20日)基金份额总额	2,000,475,963.93
基金合同生效日基金份额总额	2,000,475,963.93
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,814,974,483.54
减去：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	505,856,842.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
本报告期期末基金份额总额	7,309,593,604.77

## § 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

报告期内基金合同生效，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

报告期内本基金合同生效，初次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	
招商证券	2	551,745,880.45	100%	502,307.02	100%	1

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、本基金本报告期的交易单元均为新增租用。

### 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	757,211.8	100%	2,624,029,000	100%	—	—

## 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	关于本基金基金合同生效的公告	《上海证券报》	2015-03-21
2	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》	2015-03-31

		《上海证券报》	
3	关于本基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务及暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	《上海证券报》	2015-04-07
4	关于本基金恢复大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	《上海证券报》	2015-05-20
5	关于本基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	《上海证券报》	2015-05-29
6	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
7	关于本基金持有的招商地产进行估值调整的公告	《上海证券报》	2015-06-12
8	关于本基金恢复及暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	《上海证券报》	2015-06-16

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]286号）

《关于国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2015]711号）

《国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银新回报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

国投瑞银新回报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