

国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)2015年年度报告摘要

2015年12月31日

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016年3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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告期自2015年1月1日起至12月31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.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

7.4	报表附注.....	23
§8	投资组合报告.....	46
8.1	期末基金资产组合情况.....	46
8.3	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.....	47
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
8.6	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.....	61
8.7	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.....	61
8.8	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.....	61
8.9	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.....	61
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12	投资组合报告附注.....	61
§9	基金份额持有人信息.....	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	62
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
9.4	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.....	63
§10	开放式基金份额变动.....	63
§11	重大事件揭示.....	63
11.1	基金份额持有人大会决议.....	63
11.2	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.....	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4	基金投资策略的改变.....	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
11.8	其他重大事件.....	65
§12	备查文件目录.....	67
12.1	备查文件目录.....	67
12.2	存放地点.....	67
12.3	查阅方式.....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银新兴产业混合（LOF）
场内简称	国投新兴
基金主代码	161219
交易代码	前端：161219 / 后端：161220
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月13日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,822,631.23
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-01-16

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过股票与债券等资产的合理配置，精选战略新兴产业及其相关行业中的优质企业进行投资，分享新兴产业发展所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资人带来长期的超额收益。
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。本基金借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验，精选战略新兴产业及其相关行业中的优质上市公司股票和较高投资价值的债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。</p> <p>本基金类别资产配置比例遵循以下原则：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>（1）股票投资占基金资产的30-80%；</li> <li>（2）权证投资占基金资产的比例不高于3%；</li> <li>（3）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%。</li> </ol>
业绩比较基准	55%×中证新兴产业指数+ 45%×中债总指数

风险收益特征	本基金属于中高风险、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	中国建设银行股份有限公司
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	010-67595096
传真	0755-82904048	010-66275865

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ubssdic.com">http://www.ubssdic.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	27,073,693.18	5,326,939.43	11,466,232.24
本期利润	25,310,611.70	6,710,306.44	12,562,628.80
加权平均基金份额本期利润	0.8935	0.1074	0.1502
本期基金份额净值增长率	74.96%	14.86%	23.19%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	1.0678	0.1250	0.1433
期末基金资产净值	69,939,524.19	44,007,398.85	90,507,229.92

期末基金份额净值	2.068	1.182	1.165
----------	-------	-------	-------

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

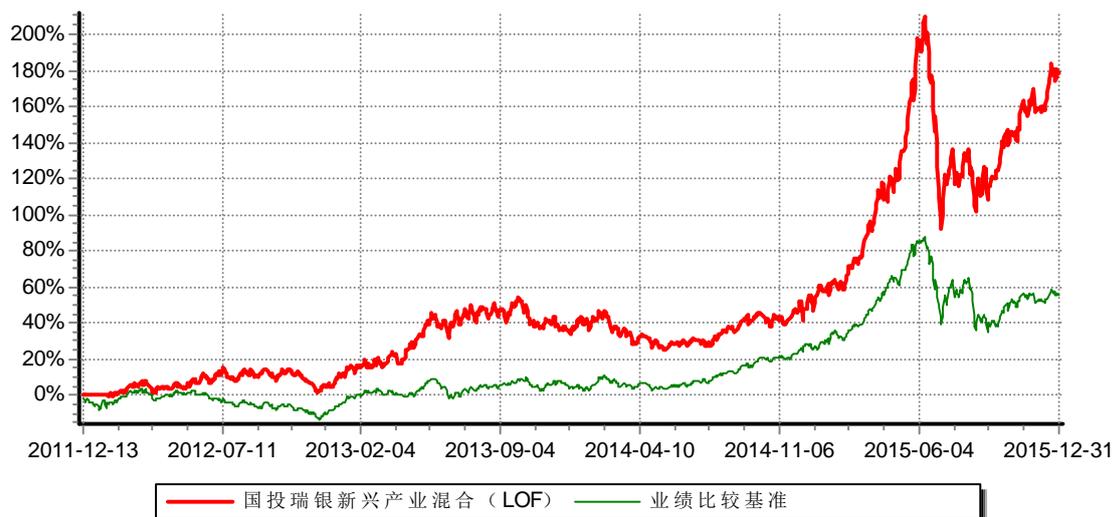
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	23.91%	1.50%	11.87%	1.10%	12.04%	0.40%
过去六个月	9.24%	2.25%	-5.25%	1.80%	14.49%	0.45%
过去一年	74.96%	2.12%	23.53%	1.57%	51.43%	0.55%
过去三年	147.55%	1.63%	63.61%	1.10%	83.94%	0.53%
自基金合同生效日起至今	178.00%	1.47%	55.59%	1.04%	122.41%	0.43%

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30-80%的中间值，即约55%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，本基金选用中证新兴产业指数和中债总指数加权作为本基金的投资业绩评价基准，具体为55%×中证新兴产业指数+ 45%×中债总指数。

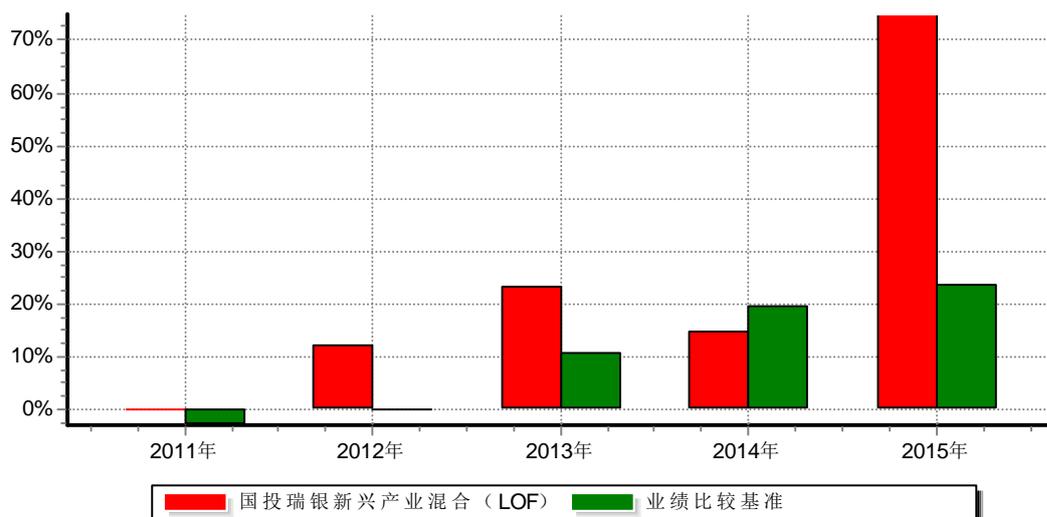
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

#### 3.2.2 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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2011年12月13日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注

2014年	1.400	6,637,280.47	4,189,596.36	10,826,876.83	
2013年	1.860	285,537,771.10	3,754,030.07	289,291,801.17	
合计	3.260	292,175,051.57	7,943,626.43	300,118,678.00	

## § 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、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止2015年12月底，公司有员工207人，其中118人具有硕士或博士学位；公司管理53只基金，其中包括2只创新型分级基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙文龙	本基金基金经理	2015年3月14日	—	6	中国籍，硕士，具有基金从业资格，2010年7月加入国投瑞银研究部，曾任国投瑞银创新动力股票型证券投资基金和国投瑞银景气行业证券投资基金的基金经理助理。现任国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)、国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银创新动力混合型

					证券投资基金基金经理。
孟亮	本基金基金经理、基金投资部副总监	2012年3月10日	2015年3月14日	10	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于上投摩根基金管理有限公司。2010年4月加入国投瑞银，曾任国投瑞银消费服务指数基金(LOF)和国投瑞银沪深300金融地产指数基金(LOF)基金经理。现任国投瑞银融华基金、国投瑞银新兴产业基金、国投瑞银创新动力基金和国投瑞银医疗保健基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)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 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度，并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则：

- 1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时，坚持基金持有人利益优先；
- 2、当不同资产委托人利益发生冲突时，应公平的对待不同的资产委托人；
- 3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合；
- 4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下：

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程，提高投资管理的科学性和客观性，确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系，加强交易分配的内部控制，通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现，同时通过监察稽核，事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下：

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统，充分发挥系统的自动控制功能，根据公平交易管理的要求，在系统中设置相应业务流转顺序、控制阈值或者触发机制，对触及阈值的行为视情况分别采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务自动执行必要的后续流程。如：符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易，内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理，控制阈值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动，通过建立明确的业务规则和流程，在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制，通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求，实现对关键业务风险的管理。如：以公司名义进行的一级市场申购结果分配，需要经过严格的公平性审核，由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后才为有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位，分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控，并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况，监督督促公平交易制度的执行。如：交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督，监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核，监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理

的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析，发现控制薄弱环节或交易价异常，将重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中，披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明，接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查，公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时，将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况，并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题，也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式，也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析，并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为，将依法采取相关监管措施。

#### 4.3.2 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。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行T检验，检验在95%的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况，

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示,公司管理的所有投资组合,在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

#### 4.3.3 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,宏观经济调结构与保增长并行,GDP增速稳步下行。央行数次下调存款准备金率和基准利率,社会融资成本持续下行,中国整体步入宽松的货币环境;改革预期不断升温,国资改革向前推进,反腐力度保持高压态势。

2015年对于资本市场而言,是值得铭记的,“水牛”、“改革牛”、“杠杆牛”共同演绎了一场悲欢离合。上半年股市气势如虹,以TMT为代表的新兴产业涨幅巨大,6月份开始股市去杠杆,历经数次千股跌停、千股涨停,下半年市场有一波较大的反弹。

本基金在上半年一直保持较高仓位,并重点配置了电子、通信、医药等行业;而下半年保持中性仓位,加大了对蓝筹股的配置,持仓更加均衡。本基金上半年基本能够跟得上市场上涨的节奏,下半年充分考虑风险收益比,选取有安全边际的标的博取收益,总体上取得了较好的效果。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为2.068元,本报告期份额净值增长率为74.96%,同期业绩比较基准收益率为23.53%。基金净值表现高于业绩基准,主要因为本基金上半年重点配置成长性行业,下半年配置更为均衡,并做了一定的择时。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年国内宏观经济依然难见明显起色,货币政策保持宽松、但利率下降空间有限。供给侧改革将成为今年中国经济的重要看点,我们认为这是增加中国经济增长质量的重要措施,我们理解供给侧改革涉及两方面的内容,一般消费品的品质提升和工业品比如钢铁、煤炭的去产能,这将对中国经济产生深远影响。从全球来看,我们密切关注美元加息的节奏,这可能是影响2016年全球资本市场最重要的变量。

2016年的股市开年就大幅下跌,也是对不确定性的一种反映,我们建议投资者降低对2016年的收益率预期。我们认为今年最重要的两个风险可能是全球流动性的拐点以及成长股的估值中枢下移,美元进入加息周期可能使得全球流动性出现拐点,这也将使得

股市的估值中枢下移。我们判断供给侧改革可能是今年的重要投资主线，我们会重点布局；另外，我们仍将继续关注国企改革的进程。

#### 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。

#### 4.87 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27,073,693.18元，期末可供分配利润为36,116,892.96元。

本基金本报告期间无利润分配事项。

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。

#### 4.98 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

报告期内本基金出现过连续二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，至本报告期末（12月31日）高于5000万元，基金管理人依据相关规定在本报告中进行披露，提醒基金份额持有人关注。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期未实施收益分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

经普华永道中天会计师事务所审计，注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		22,556,937.34	8,322,640.34
结算备付金		599,768.56	144,673.55
存出保证金		104,499.56	22,450.29
交易性金融资产		45,382,748.63	35,702,387.85
其中：股票投资		45,382,748.63	35,171,431.05
基金投资		—	—

债券投资		—	530,956.80
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产		—	—
应收证券清算款		4,585,168.38	463,881.26
应收利息		5,235.17	3,457.15
应收股利		—	—
应收申购款		703,942.63	264,390.81
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		73,938,300.27	44,923,881.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31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		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		3,154,683.74	—
应付赎回款		242,998.71	458,405.12
应付管理人报酬		73,314.07	57,421.92
应付托管费		12,219.01	9,570.33
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		389,653.01	129,379.90
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		125,907.54	261,705.13

负债合计		3,998,776.08	916,482.40
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		33,822,631.23	37,223,283.78
未分配利润		36,116,892.96	6,784,115.07
所有者权益合计		69,939,524.19	44,007,398.85
负债和所有者权益总计		73,938,300.27	44,923,881.25

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值2.068元，基金份额总额33,822,631.23份。

## 7.2 利润表

会计主体：国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年12月31日
<b>一、收入</b>		27,574,609.02	9,059,494.71
1. 利息收入		120,122.63	140,457.64
其中：存款利息收入		117,632.96	102,769.14
债券利息收入		2,489.67	24,300.99
资产支持证券利息收 入		—	—
买入返售金融资产收 入		—	13,387.51
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		29,101,351.37	7,487,225.87
其中：股票投资收益		29,386,490.58	6,544,790.50
基金投资收益		—	—
债券投资收益		-447,134.57	424,683.78
资产支持证券投资收 益		—	—

贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益		161,995.36	517,751.59
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-1,763,081.48	1,383,367.01
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—	—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		116,216.50	48,444.19
<b>减：二、费用</b>		<b>2,263,997.32</b>	<b>2,349,188.27</b>
1. 管理人报酬		702,355.68	962,552.09
2. 托管费		117,059.37	160,425.36
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		1,295,414.57	783,973.29
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用		149,167.70	442,237.53
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>25,310,611.70</b>	<b>6,710,306.44</b>
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>25,310,611.70</b>	<b>6,710,306.44</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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	37,223,283.78	6,784,115.07	44,007,398.85

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	25,310,611.70	25,310,611.70
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)	-3,400,652.55	4,022,166.19	621,513.64
其中：1. 基金申购款	68,559,376.70	49,144,523.56	117,703,900.26
2. 基金赎回款	-71,960,029.25	-45,122,357.37	-117,082,386.62
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)	33,822,631.23	36,116,892.96	69,939,524.19
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	77,709,711.31	12,797,518.61	90,507,229.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	6,710,306.44	6,710,306.44
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)	-40,486,427.53	-1,896,833.15	-42,383,260.68
其中：1. 基金申购款	16,068,240.72	904,499.85	16,972,740.57
2. 基金赎回款	-56,554,668.25	-2,801,333.00	-59,356,001.25
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)	—	-10,826,876.83	-10,826,876.83
五、期末所有者权益(基金净值)	37,223,283.78	6,784,115.07	44,007,398.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王彬	王彬	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)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[2011]第1300号《关于核准国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准, 由国投瑞银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式基金, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集649, 908, 473. 80元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第490号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2011年12月13日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为650, 038, 306. 37份基金份额, 其中认购资金利息折合129, 832. 57份基金份额。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2012]第5号文审核同意, 本基金190, 800, 265. 00份基金份额于2012年1月16日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 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、货币市场工具、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。本基金的股票投资比例为基金资产的30%-80%, 其中投资于战略新兴产业及其相关行业股票的比例不低于股票资产的80%, 投资于权证的比例不超过基金资产的3%; 现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为20%-70%, 其中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%。本基金的业绩比较基准为:  $55\% \times \text{中证新兴产业指数} + 45\% \times \text{中债总指数}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人国投瑞银基金管理有限公司于2016年03月25日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,本基金基金管理人对2015年度出现基金资产净值低于人民币五千万元的情况已在本基金2015年度定期报告中予以披露,本财务报表以持续经营为编制基础。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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

除下述事项外,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。对于在证券交易所上市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),按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本期无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.97 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国投泰康信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东
国投瑞银资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
国投瑞银资本管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 根据国投泰康信托有限公司于2015年2月27日发布的公告，国投信托有限公司根据银监复(2014)962号增资扩股并引入新的股东，增资后公司名称由“国投信托有限公司”变更为“国投泰康信托有限公司”。

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	702,355.68	962,552.09
其中:支付销售机构的客户维护费	169,593.53	255,937.53

注:支付基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	117,059.37	160,425.36

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	22,556,937.34	110,184.31	8,322,640.34	98,871.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600729	重庆百货	2015-07-24	重大事项	29.26	2016-01-04	29.90	31,900	1,035,246.00	933,394.00

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层级金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 44,449,354.63 元，属于第二层次的余额为 933,394.00 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 30,368,026.50 元，第二层次 5,334,361.35 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价

值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	45,382,748.63	61.38
	其中：股票	45,382,748.63	61.38
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	23,156,705.90	31.32
7	其他各项资产	5,398,845.74	7.30
8	合计	73,938,300.27	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

### 8.2 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	34,480,485.63	49.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,999,416.00	2.86
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	3,962,413.00	5.67
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	2,040,175.00	2.92
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	2,900,259.00	4.15
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	—	—
	合计	45,382,748.63	64.89

### 8.3 期末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	601028	玉龙股份	533,800	5,001,706.00	7.15
2	601616	广电电气	392,100	3,375,981.00	4.83
3	603006	黎明股份	51,700	3,253,998.00	4.65
4	600485	信威集团	116,000	3,103,000.00	4.44
5	600422	昆药集团	77,800	3,097,996.00	4.43
6	600351	亚宝药业	198,100	3,094,322.00	4.42
7	002510	天汽模	171,400	3,038,922.00	4.35
8	601888	中国国旅	48,900	2,900,259.00	4.15
9	600678	四川金顶	104,077	2,881,892.13	4.12
10	002650	加加食品	289,300	2,349,116.00	3.36

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	300136	信维通信	9,172,314.40	20.84
2	002236	大华股份	8,193,652.00	18.62
3	601028	玉龙股份	6,943,882.31	15.78
4	002363	隆基机械	6,805,319.72	15.46
5	000911	南宁糖业	6,647,919.41	15.11
6	002510	天汽模	5,991,760.41	13.62
7	002332	仙琚制药	5,156,690.80	11.72
8	601888	中国国旅	5,155,748.44	11.72
9	601009	南京银行	4,809,975.92	10.93
10	600422	昆药集团	4,756,673.00	10.81
11	002475	立讯精密	4,633,926.84	10.53
12	002217	合力泰	4,419,848.00	10.04
13	600501	航天晨光	4,138,774.00	9.40
14	300234	开尔新材	4,049,612.90	9.20
15	600865	百大集团	3,824,666.25	8.69
16	601901	方正证券	3,663,392.00	8.32
17	600276	恒瑞医药	3,662,091.00	8.32
18	601688	华泰证券	3,499,491.60	7.95
19	002657	中科金财	3,425,722.00	7.78
20	000538	云南白药	3,353,310.00	7.62
21	600016	民生银行	3,322,762.00	7.55
22	600566	济川药业	3,254,338.04	7.39
23	002280	联络互动	3,204,018.50	7.28
24	000957	中通客车	3,165,210.00	7.19
25	600485	信威集团	3,092,086.00	7.03
26	600730	中国高科	3,074,997.08	6.99
27	300013	新宁物流	3,055,703.00	6.94

28	300303	聚飞光电	3,026,408.62	6.88
29	601616	广电电气	2,941,952.00	6.69
30	002445	中南重工	2,827,942.00	6.43
31	000638	万方发展	2,722,603.20	6.19
32	000651	格力电器	2,697,125.00	6.13
33	000915	山大华特	2,679,212.00	6.09
34	600351	亚宝药业	2,676,122.00	6.08
35	000547	航天发展	2,658,858.01	6.04
36	600362	江西铜业	2,616,712.00	5.95
37	600050	中国联通	2,573,277.98	5.85
38	300205	天喻信息	2,569,152.30	5.84
39	002491	通鼎互联	2,520,579.00	5.73
40	600257	大湖股份	2,510,726.00	5.71
41	600677	航天通信	2,510,583.00	5.70
42	300183	东软载波	2,496,934.50	5.67
43	601668	中国建筑	2,469,038.00	5.61
44	300146	汤臣倍健	2,437,002.40	5.54
45	600958	东方证券	2,417,086.00	5.49
46	600678	四川金顶	2,411,095.75	5.48
47	300043	互动娱乐	2,368,398.50	5.38
48	603006	黎明股份	2,359,665.90	5.36
49	600529	山东药玻	2,344,876.45	5.33
50	600499	科达洁能	2,340,878.00	5.32
51	300237	美晨科技	2,240,840.00	5.09
52	002718	友邦吊顶	2,193,080.00	4.98
53	002080	中材科技	2,187,718.40	4.97
54	002247	帝龙新材	2,157,578.00	4.90
55	300120	经纬电材	2,152,311.00	4.89
56	000002	万 科 A	2,145,343.64	4.87
57	601318	中国平安	2,141,170.69	4.87

58	002650	加加食品	2,128,743.00	4.84
59	600850	华东电脑	2,100,637.00	4.77
60	000955	欣龙控股	2,100,232.00	4.77
61	002329	皇氏集团	2,094,017.00	4.76
62	002516	旷达科技	2,087,967.00	4.74
63	002299	圣农发展	2,079,007.00	4.72
64	600879	航天电子	2,071,165.00	4.71
65	300344	太空板业	2,069,674.00	4.70
66	600118	中国卫星	2,064,327.80	4.69
67	000601	韶能股份	2,042,820.00	4.64
68	002077	大港股份	2,042,527.88	4.64
69	002170	芭田股份	2,023,471.00	4.60
70	300163	先锋新材	1,992,222.60	4.53
71	601058	赛轮金宇	1,989,440.00	4.52
72	300207	欣旺达	1,969,856.96	4.48
73	300070	碧水源	1,959,248.00	4.45
74	002454	松芝股份	1,950,685.00	4.43
75	300166	东方国信	1,949,260.00	4.43
76	600373	中文传媒	1,931,656.46	4.39
77	002613	北玻股份	1,929,118.00	4.38
78	000705	浙江震元	1,927,751.00	4.38
79	600475	华光股份	1,915,054.00	4.35
80	000829	天音控股	1,897,705.00	4.31
81	300211	亿通科技	1,893,850.73	4.30
82	600873	梅花生物	1,882,673.00	4.28
83	300270	中威电子	1,876,705.00	4.26
84	603308	应流股份	1,863,778.00	4.24
85	002518	科士达	1,859,163.00	4.22
86	600077	宋都股份	1,833,888.00	4.17
87	601007	金陵饭店	1,825,817.00	4.15

88	601336	新华保险	1,825,353.78	4.15
89	600986	科达股份	1,813,264.00	4.12
90	000901	航天科技	1,805,877.96	4.10
91	002644	佛慈制药	1,803,972.01	4.10
92	603669	灵康药业	1,796,618.00	4.08
93	002251	步步高	1,774,409.00	4.03
94	600125	铁龙物流	1,773,666.00	4.03
95	300314	戴维医疗	1,744,051.74	3.96
96	603456	九洲药业	1,734,803.00	3.94
97	002410	广联达	1,734,782.32	3.94
98	300232	洲明科技	1,730,439.00	3.93
99	002483	润邦股份	1,726,476.00	3.92
100	300016	北陆药业	1,725,267.00	3.92
101	000503	海虹控股	1,719,943.97	3.91
102	002601	佰利联	1,719,654.00	3.91
103	002139	拓邦股份	1,703,724.82	3.87
104	600551	时代出版	1,672,966.00	3.80
105	600816	安信信托	1,672,551.00	3.80
106	002590	万安科技	1,652,827.00	3.76
107	600596	新安股份	1,612,386.00	3.66
108	300165	天瑞仪器	1,605,968.00	3.65
109	300019	硅宝科技	1,602,336.00	3.64
110	600090	啤酒花	1,598,712.00	3.63
111	001696	宗申动力	1,596,537.72	3.63
112	600426	华鲁恒升	1,592,780.00	3.62
113	600801	华新水泥	1,588,988.02	3.61
114	002133	广宇集团	1,576,524.00	3.58
115	600423	柳化股份	1,570,641.00	3.57
116	600138	中青旅	1,563,494.00	3.55
117	600059	古越龙山	1,561,497.90	3.55

118	600703	三安光电	1,552,132.00	3.53
119	002431	棕榈园林	1,535,467.00	3.49
120	002216	三全食品	1,505,921.96	3.42
121	600088	中视传媒	1,500,447.48	3.41
122	002384	东山精密	1,484,043.00	3.37
123	600548	深高速	1,476,993.90	3.36
124	600525	长园集团	1,473,022.00	3.35
125	000666	经纬纺机	1,469,111.00	3.34
126	600500	中化国际	1,465,990.00	3.33
127	002773	康弘药业	1,458,298.00	3.31
128	600628	新世界	1,444,448.00	3.28
129	300304	云意电气	1,392,904.99	3.17
130	002594	比亚迪	1,389,968.00	3.16
131	000593	大通燃气	1,316,076.00	2.99
132	002396	星网锐捷	1,311,884.00	2.98
133	000933	神火股份	1,305,745.00	2.97
134	300212	易华录	1,300,944.00	2.96
135	002672	东江环保	1,284,547.55	2.92
136	600325	华发股份	1,249,473.00	2.84
137	002234	民和股份	1,218,993.00	2.77
138	601801	皖新传媒	1,218,788.00	2.77
139	603939	益丰药房	1,214,638.00	2.76
140	002458	益生股份	1,190,900.00	2.71
141	002010	传化股份	1,185,492.00	2.69
142	000789	万年青	1,176,564.00	2.67
143	600038	中直股份	1,166,356.00	2.65
144	600079	人福医药	1,156,017.40	2.63
145	300018	中元华电	1,155,980.00	2.63
146	002081	金螳螂	1,155,937.00	2.63
147	300400	劲拓股份	1,152,435.45	2.62

148	000596	古井贡酒	1,115,080.00	2.53
149	300202	聚龙股份	1,111,546.00	2.53
150	300128	锦富新材	1,101,366.00	2.50
151	002123	荣信股份	1,094,192.00	2.49
152	002407	多氟多	1,093,434.00	2.48
153	600305	恒顺醋业	1,080,513.00	2.46
154	600757	长江传媒	1,074,115.00	2.44
155	002630	华西能源	1,073,344.00	2.44
156	000543	皖能电力	1,071,689.00	2.44
157	002026	山东威达	1,052,898.00	2.39
158	002398	建研集团	1,051,963.00	2.39
159	000400	许继电气	1,047,691.00	2.38
160	002178	延华智能	1,042,570.00	2.37
161	000712	锦龙股份	1,039,880.64	2.36
162	300275	梅安森	1,037,226.00	2.36
163	600729	重庆百货	1,035,246.00	2.35
164	600697	欧亚集团	1,034,352.00	2.35
165	002348	高乐股份	1,025,067.00	2.33
166	300458	全志科技	1,004,346.02	2.28
167	300032	金龙机电	993,123.10	2.26
168	000587	金叶珠宝	980,708.00	2.23
169	601700	风范股份	958,014.00	2.18
170	002052	同洲电子	953,785.00	2.17
171	600844	丹化科技	928,414.00	2.11
172	600588	用友网络	913,458.60	2.08
173	300292	吴通控股	907,365.00	2.06
174	600893	中航动力	893,988.00	2.03

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。

#### 8.4.2 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	300136	信维通信	12,545,778.15	28.51
2	002236	大华股份	8,377,029.92	19.04
3	002363	隆基机械	5,648,339.80	12.83
4	600016	民生银行	5,507,370.02	12.51
5	000911	南宁糖业	5,330,305.22	12.11
6	002332	仙琚制药	5,060,021.18	11.50
7	601688	华泰证券	4,896,844.00	11.13
8	601318	中国平安	4,824,798.70	10.96
9	002475	立讯精密	4,818,616.00	10.95
10	601901	方正证券	4,699,191.00	10.68
11	600865	百大集团	4,650,951.60	10.57
12	601009	南京银行	4,564,900.88	10.37
13	002217	合力泰	4,311,085.44	9.80
14	300234	开尔新材	4,116,415.04	9.35
15	002510	天汽模	4,042,585.00	9.19
16	600501	航天晨光	4,040,887.58	9.18
17	000957	中通客车	3,620,953.75	8.23
18	600276	恒瑞医药	3,618,623.85	8.22
19	002657	中科金财	3,589,335.86	8.16
20	601668	中国建筑	3,450,897.00	7.84
21	600566	济川药业	3,352,295.86	7.62
22	300013	新宁物流	3,325,999.80	7.56
23	300303	聚飞光电	3,205,989.88	7.29
24	600730	中国高科	3,193,516.05	7.26
25	600257	大湖股份	3,127,649.04	7.11
26	002280	联络互动	3,040,298.45	6.91
27	000651	格力电器	2,991,775.72	6.80
28	600118	中国卫星	2,960,103.04	6.73

29	300314	戴维医疗	2,949,628.61	6.70
30	000538	云南白药	2,945,535.60	6.69
31	002247	帝龙新材	2,900,347.65	6.59
32	000547	航天发展	2,892,930.92	6.57
33	000901	航天科技	2,892,021.00	6.57
34	300207	欣旺达	2,827,929.54	6.43
35	002445	中南重工	2,790,453.45	6.34
36	300032	金龙机电	2,709,946.00	6.16
37	000638	万方发展	2,687,867.80	6.11
38	000829	天音控股	2,658,383.00	6.04
39	600958	东方证券	2,647,703.00	6.02
40	600422	昆药集团	2,636,734.00	5.99
41	600677	航天通信	2,614,784.75	5.94
42	601166	兴业银行	2,605,156.03	5.92
43	300043	互动娱乐	2,602,790.10	5.91
44	000915	山大华特	2,588,717.00	5.88
45	002050	三花股份	2,568,471.50	5.84
46	002491	通鼎互联	2,565,986.01	5.83
47	002518	科士达	2,517,706.00	5.72
48	300183	东软载波	2,505,943.00	5.69
49	600529	山东药玻	2,503,855.43	5.69
50	600362	江西铜业	2,486,822.00	5.65
51	300344	太空板业	2,475,736.00	5.63
52	000955	欣龙控股	2,458,663.00	5.59
53	600050	中国联通	2,424,242.54	5.51
54	601888	中国国旅	2,376,472.00	5.40
55	002329	皇氏集团	2,370,550.00	5.39
56	300205	天喻信息	2,356,463.00	5.35
57	002077	大港股份	2,325,630.50	5.28
58	000024	招商地产	2,316,653.00	5.26

59	002509	天广消防	2,280,336.00	5.18
60	600499	科达洁能	2,245,225.00	5.10
61	600570	恒生电子	2,177,363.00	4.95
62	600879	航天电子	2,162,669.06	4.91
63	300232	洲明科技	2,153,778.00	4.89
64	002773	康弘药业	2,128,385.44	4.84
65	002516	旷达科技	2,123,342.56	4.82
66	601058	赛轮金宇	2,121,821.00	4.82
67	300237	美晨科技	2,109,760.00	4.79
68	002170	芭田股份	2,109,670.51	4.79
69	300166	东方国信	2,091,968.98	4.75
70	600000	浦发银行	2,089,986.35	4.75
71	000705	浙江震元	2,082,183.18	4.73
72	600373	中文传媒	2,058,918.75	4.68
73	002454	松芝股份	2,035,326.66	4.62
74	000002	万 科 A	2,033,698.00	4.62
75	600873	梅花生物	2,033,210.33	4.62
76	300070	碧水源	2,004,064.00	4.55
77	600475	华光股份	2,000,254.00	4.55
78	600986	科达股份	1,998,644.70	4.54
79	600309	万华化学	1,990,803.05	4.52
80	300211	亿通科技	1,977,307.00	4.49
81	002299	圣农发展	1,972,378.81	4.48
82	002590	万安科技	1,941,260.70	4.41
83	600551	时代出版	1,932,142.71	4.39
84	600125	铁龙物流	1,929,674.00	4.38
85	002410	广联达	1,929,204.00	4.38
86	002483	润邦股份	1,918,400.00	4.36
87	603456	九洲药业	1,917,280.14	4.36
88	002613	北玻股份	1,891,449.65	4.30

89	601336	新华保险	1,886,112.18	4.29
90	603669	灵康药业	1,868,650.91	4.25
91	300168	万达信息	1,821,961.80	4.14
92	601007	金陵饭店	1,820,914.00	4.14
93	300016	北陆药业	1,816,117.30	4.13
94	600077	宋都股份	1,802,811.61	4.10
95	300120	经纬电材	1,802,421.00	4.10
96	002384	东山精密	1,771,605.97	4.03
97	601028	玉龙股份	1,719,972.00	3.91
98	002601	佰利联	1,706,169.77	3.88
99	002139	拓邦股份	1,704,662.84	3.87
100	002718	友邦吊顶	1,698,331.34	3.86
101	001696	宗申动力	1,693,229.00	3.85
102	002644	佛慈制药	1,692,947.40	3.85
103	300270	中威电子	1,685,443.00	3.83
104	300098	高新兴	1,679,321.60	3.82
105	002133	广宇集团	1,672,667.00	3.80
106	600525	长园集团	1,623,791.00	3.69
107	300019	硅宝科技	1,618,283.80	3.68
108	600548	深高速	1,603,946.28	3.64
109	002251	步步高	1,601,580.62	3.64
110	600801	华新水泥	1,596,374.53	3.63
111	000503	海虹控股	1,591,297.00	3.62
112	300165	天瑞仪器	1,586,447.00	3.60
113	600036	招商银行	1,581,001.66	3.59
114	300146	汤臣倍健	1,562,951.00	3.55
115	600816	安信信托	1,561,166.58	3.55
116	002216	三全食品	1,538,423.01	3.50
117	002080	中材科技	1,528,372.84	3.47
118	600500	中化国际	1,507,266.00	3.43

119	600088	中视传媒	1,498,840.76	3.41
120	002123	荣信股份	1,494,433.49	3.40
121	002396	星网锐捷	1,455,204.00	3.31
122	002081	金螳螂	1,450,208.55	3.30
123	600138	中青旅	1,443,109.16	3.28
124	300212	易华录	1,417,092.00	3.22
125	000666	经纬纺机	1,412,744.52	3.21
126	002672	东江环保	1,406,717.50	3.20
127	603939	益丰药房	1,400,905.00	3.18
128	600588	用友网络	1,390,202.00	3.16
129	600090	啤酒花	1,386,245.00	3.15
130	600596	新安股份	1,379,254.00	3.13
131	600038	中直股份	1,360,921.00	3.09
132	603308	应流股份	1,360,810.00	3.09
133	600703	三安光电	1,357,790.60	3.09
134	300181	佐力药业	1,352,501.30	3.07
135	000789	万年青	1,350,818.00	3.07
136	300275	梅安森	1,315,032.00	2.99
137	601801	皖新传媒	1,314,670.00	2.99
138	002594	比亚迪	1,314,262.20	2.99
139	002407	多氟多	1,308,658.00	2.97
140	600240	华业资本	1,306,366.70	2.97
141	600030	中信证券	1,266,731.08	2.88
142	600325	华发股份	1,264,018.00	2.87
143	002458	益生股份	1,241,825.00	2.82
144	600079	人福医药	1,206,707.58	2.74
145	002630	华西能源	1,203,116.80	2.73
146	600426	华鲁恒升	1,202,201.00	2.73
147	300400	劲拓股份	1,198,523.40	2.72
148	300458	全志科技	1,187,880.00	2.70

149	300018	中元华电	1,184,377.00	2.69
150	002178	延华智能	1,174,630.00	2.67
151	002052	同洲电子	1,168,586.00	2.66
152	002010	传化股份	1,157,599.04	2.63
153	300128	锦富新材	1,150,694.54	2.61
154	000543	皖能电力	1,139,922.00	2.59
155	601628	中国人寿	1,131,814.40	2.57
156	600844	丹化科技	1,125,859.00	2.56
157	002398	建研集团	1,119,142.00	2.54
158	300202	聚龙股份	1,109,192.82	2.52
159	600590	泰豪科技	1,103,541.00	2.51
160	600697	欧亚集团	1,100,552.00	2.50
161	002065	东华软件	1,099,990.00	2.50
162	000596	古井贡酒	1,091,318.00	2.48
163	002431	棕榈园林	1,091,047.00	2.48
164	002121	科陆电子	1,078,893.00	2.45
165	600352	浙江龙盛	1,075,457.57	2.44
166	002026	山东威达	1,051,759.89	2.39
167	002234	民和股份	1,045,089.00	2.37
168	000926	福星股份	1,030,154.59	2.34
169	600410	华胜天成	1,028,530.00	2.34
170	601700	风范股份	1,021,321.24	2.32
171	600757	长江传媒	1,015,772.00	2.31
172	000712	锦龙股份	1,009,294.77	2.29
173	601988	中国银行	1,007,748.00	2.29
174	002117	东港股份	1,002,136.00	2.28
175	601390	中国中铁	999,783.00	2.27
176	002348	高乐股份	998,386.00	2.27
177	000400	许继电气	987,457.00	2.24
178	600893	中航动力	987,223.00	2.24

179	002456	欧菲光	984,944.00	2.24
180	600059	古越龙山	977,666.00	2.22
181	600423	柳化股份	973,064.00	2.21
182	000587	金叶珠宝	971,214.00	2.21
183	300009	安科生物	960,883.00	2.18
184	600388	龙净环保	932,377.00	2.12
185	300292	吴通控股	930,725.00	2.11
186	600837	海通证券	920,422.56	2.09
187	300163	先锋新材	904,291.48	2.05
188	600479	千金药业	903,860.90	2.05
189	603678	火炬电子	897,645.00	2.04
190	300199	翰宇药业	884,583.00	2.01

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	414,249,960.56
卖出股票的收入（成交）总额	431,720,129.79

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。

#### 8.5 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投资。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 8.8 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。

### 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	104,499.56
2	应收证券清算款	4,585,168.38
3	应收股利	—
4	应收利息	5,235.17
5	应收申购款	703,942.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,398,845.74

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
15,058	2,246.16	3,000,100.00	8.87%	30,822,531.23	91.13%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
0	胡桂绵	174,575.00	16.30%
1	奚红	130,000.00	12.13%
2	高德荣	49,200.00	4.59%
3	王宝琦	46,858.00	4.37%
4	周锦玮	45,000.00	4.20%
5	周育强	37,415.00	3.49%
6	秦幼琴	30,001.00	2.80%
7	贾守宁	29,451.00	2.75%
8	王小平	27,358.00	2.55%
9	宫海堃	27,012.00	2.52%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 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	3,269,850.18	9.67%

金		
---	--	--

#### 9.4 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月13日)基金份额总额	650,038,306.37
本报告期期初基金份额总额	37,223,283.78
本报告期基金总申购份额	68,559,376.70
减：本报告期基金总赎回份额	71,960,029.25
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	33,822,631.23

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 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，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、袁野先生自2015年9月9日起任管理人副总经理。
- 2、袁野先生自2015年10月19日起兼任国投瑞银资本副总经理。

另，刘纯亮先生自2016年2月3日起不再任管理人总经理，王彬女士接任管理人总经理；包爱丽女士自2016年2月3日起不再任管理人副总经理。

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

#### 11.3 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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金基金投资策略未发生变化。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金连续提供审计服务4年。报告期内应支付给该事务所的报酬为55,000.00元。

#### 11.6 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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例
安信证券	1	490,080,327.56	57.93%	452,888.68	57.94%
财达证券	1	266,199,722.87	31.47%	247,068.84	31.61%
海通证券	1	64,890,144.31	7.67%	59,141.94	7.57%
广发证券	1	24,799,895.61	2.93%	22,577.82	2.89%

##### 11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
财达证券	8,988,687.32	78.94%	—	—	—	—
海通证券	2,398,731.50	21.06%	—	—	—	—

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、本基金本报告期未发生交易所回购及权证交易。
- 3、本基金本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日