



# 信息披露

2016年3月28日 星期一  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B68

## 国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)

### 2015 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<br>基金托管人:中国工商银行股份有限公司<br>送出日期:2016年3月28日 | §1 重要提示及目录 |
| 1.1 重要提示                                                    |            |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                      |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| 基金管理人承诺,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法律责任。本年度报告已经会计师事务所审计,并出具标准无保留意见。<br>基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年3月28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。<br>本报告所载数据截至2015年12月31日。<br>本报告所载数据截至2015年12月31日止。<br>本报告所载数据截至2015年12月31日止。 | §2 基金简介 |
| 2.1 基金基本情况                                                                                                                                                                                                                                                                           |         |

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 基金名称       | 国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF) |
| 简称         | 国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF) |
| 基金代码       | 161213 / 场内:161215           |
| 交易代码       | 161213 / 场内:161215           |
| 基金运作方式     | 上市型开放式                       |
| 基金合同生效日    | 2010年12月16日                  |
| 基金管理人      | 国投瑞银基金管理有限公司                 |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司                 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,188,643.59                |
| 基金存续期限     | 不定期                          |
| 基金上市证券交易所  | 深圳证券交易所                      |
| 上市日期       | 2011-01-20                   |

|            |                                                                                                                            |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.2 基金产品说明 |                                                                                                                            |
| 投资目标       | 本基金通过投资于下游消费与服务产业指数成分股,跟踪该指数的表现,追求基金资产净值长期增值,并力争在控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值。                                                     |
| 投资策略       | 本基金为被动式指数基金,采用完全复制指数的方法跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的构成成份股及其权重,构建与标的指数风险收益特征相似的基金资产组合,并定期对投资组合权重进行动态调整,以紧密跟踪标的指数的表现,力求实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 业绩比较基准     | 95%×中证下游消费与服务产业指数收益率+5%×银行间国债利率(税后)                                                                                        |
| 风险收益特征     | 本基金为股票型基金,属于中高风险品种,其风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。                                                                            |

|                         |                         |                      |
|-------------------------|-------------------------|----------------------|
| 2.4 信息披露方式              |                         |                      |
| 登载基金年度报告正文的管理人互<br>联网网址 | http://www.ubidc.com    |                      |
| 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 |                      |
| 2.5 其他相关资料              |                         |                      |
| 项目                      | 名称                      | 办公地址                 |
| 会计师事务所                  | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)    | 上海市湖南路202号普华永道中心11楼  |
| 注册登记机构                  | 中国证券登记结算有限责任公司          | 北京市西城区金融大街27号投资广场23层 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

|                 |  |
|-----------------|--|
| §3 主要会计数据和财务指标  |  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 |  |

|               |               |                |                |
|---------------|---------------|----------------|----------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015年         | 2014年          | 2013年          |
| 本期实现收益        | 48,858,732.06 | 16,787,639.09  | -7,760,735.66  |
| 本期利润          | 42,451,681.34 | 13,457,908.02  | -67,402,410.26 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.5989        | 0.1502         | -0.1291        |
| 本期加权平均基金份额利润  | 0.5989        | 0.1502         | -0.1291        |
| 本期基金份额净值增长率   | 46.26%        | 33.52%         | 20.99%         |
| 3.1.2 期间数据和指标 | 2015年末        | 2014年末         | 2013年末         |
| 期末可供分配利润      | 23,205,081.29 | -33,148,758.77 | -35,473,500.99 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4624        | -0.6643        | -0.7129        |
| 期末基金资产净值      | 73,393,724.88 | 141,560,723.20 | 250,074,122.70 |
| 期末基金份额净值      | 1.462         | 1.095          | 0.905          |
| 3.1.3 累计相关指标  | 2015年末        | 2014年末         | 2013年末         |
| 基金份额净值增长率     | 46.26%        | 33.52%         | 20.99%         |
| 3.1.4 期间数据和指标 | 2015年         | 2014年          | 2013年          |
| 期间费用          | 23,205,081.29 | -33,148,758.77 | -35,473,500.99 |
| 期间费用占基金资产净值   | 0.4624        | -0.6643        | -0.7129        |
| 期间费用占基金份额净值   | 0.4624        | -0.6643        | -0.7129        |
| 3.1.5 累计相关指标  | 2015年末        | 2014年末         | 2013年末         |
| 基金份额净值增长率     | 46.26%        | 33.52%         | 20.99%         |

|                                                                                |
|--------------------------------------------------------------------------------|
| 注 1、本期已实现收益指基金公允价值收入、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。 |
| 注 2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表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）。                  |
| 注 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据。         |
| 3.2 基金净值表现                                                                     |
| 3.2.1 基金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<br>(%) | 份额净值增长率<br>标准差(%) | 业绩比较基准<br>收益率(%) | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|----------------|-------------------|------------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -20.33%        | 1.82%             | 17.14%           | 1.71%                 | 3.19% | 0.11% |
| 过去六个月 | -13.44%        | 2.99%             | -13.69%          | 2.73%                 | 0.25% | 0.26% |
| 过去一年  | 33.52%         | 2.63%             | 32.33%           | 2.46%                 | 1.19% | 0.17% |
| 过去三年  | 85.53%         | 1.77%             | 81.17%           | 1.69%                 | 4.36% | 0.08% |

|             |        |       |        |       |        |       |
|-------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去五年        | 46.44% | 1.55% | 37.97% | 1.50% | 8.67%  | 0.05% |
| 自基金合同生效日起至今 | 46.20% | 1.54% | 30.89% | 1.50% | 15.31% | 0.04% |

注：1、本基金是以中证下游消费与服务产业指数为标的指数的被动式、指数型基金，对中证下游消费与服务产业指数成份股的配置基准为95%，并适度运用期货对冲策略降低跟踪误差，故以95%×中证下游消费与服务产业指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）为业绩比较基准，能够较为准确地反映本基金的证券投资情况。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2.2.2.2 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

|                                          |                |                   |                  |                     |       |       |
|------------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|---------------------|-------|-------|
| 3.2.2.2.2.2 基金业绩表现                       |                |                   |                  |                     |       |       |
| 3.2.2.2.2.2.1 基金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<br>(%) | 份额净值增长率<br>标准差(%) | 业绩比较基准<br>收益率(%) | 业绩比较基准<br>收益率标准差(%) | ①-③   | ②-④   |
| 过去三个月                                    | -20.34%        | 1.82%             | -17.40%          | 1.71%               | 3.19% | 0.11% |
| 过去六个月                                    | -13.44%        | 2.99%             | -13.00%          | 2.73%               | 0.25% | 0.26% |
| 过去一年                                     | 33.52%         | 2.63%             | 32.33%           | 2.46%               | 1.19% | 0.17% |
| 过去三年                                     | 85.53%         | 1.77%             | 81.17%           | 1.69%               | 4.36% | 0.08% |
| 过去五年                                     | 46.44%         | 1.55%             | 37.97%           | 1.50%               | 8.67% | 0.05% |
| 3.2.2.2.2.2.2 基金业绩表现                     |                |                   |                  |                     |       |       |
| 3.2.2.2.2.2.2.1 基金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<br>(%) | 份额净值增长率<br>标准差(%) | 业绩比较基准<br>收益率(%) | 业绩比较基准<br>收益率标准差(%) | ①-③   | ②-④   |
| 过去三个月                                    | -20.34%        | 1.82%             | -17.40%          | 1.71%               | 3.19% | 0.11% |
| 过去六个月                                    | -13.44%        | 2.99%             | -13.00%          | 2.73%               | 0.25% | 0.26% |
| 过去一年                                     | 33.52%         | 2.63%             | 32.33%           | 2.46%               | 1.19% | 0.17% |
| 过去三年                                     | 85.53%         | 1.77%             | 81.17%           | 1.69%               | 4.36% | 0.08% |
| 过去五年                                     | 46.44%         | 1.55%             | 37.97%           | 1.50%               | 8.67% | 0.05% |

|                                            |                |
|--------------------------------------------|----------------|
| 3.2.2.2.2.2.2.1 基金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<br>(%) |
| 过去三个月                                      | -20.34%        |
| 过去六个月                                      | -13.44%        |
| 过去一年                                       | 33.52%         |
| 过去三年                                       | 85.53%         |
| 过去五年                                       | 46.44%         |
| 3.2.2.2.2.2.2.2 基金业绩表现                     |                |
| 3.2.2.2.2.2.2.2.1 基金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<br>(%) |
| 过去三个月                                      | -20.34%        |
| 过去六个月                                      | -13.44%        |
| 过去一年                                       | 33.52%         |
| 过去三年                                       | 85.53%         |
| 过去五年                                       | 46.44%         |

|                                            |                |                   |                  |                     |       |       |
|--------------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|---------------------|-------|-------|
| 3.2.2.2.2.2.2.2 基金业绩表现                     |                |                   |                  |                     |       |       |
| 3.2.2.2.2.2.2.2.1 基金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<br>(%) | 份额净值增长率<br>标准差(%) | 业绩比较基准<br>收益率(%) | 业绩比较基准<br>收益率标准差(%) | ①-③   | ②-④   |
| 过去三个月                                      | -20.34%        | 1.82%             | -17.40%          | 1.71%               | 3.19% | 0.11% |
| 过去六个月                                      | -13.44%        | 2.99%             | -13.00%          | 2.73%               | 0.25% | 0.26% |
| 过去一年                                       | 33.52%         | 2.63%             | 32.33%           | 2.46%               | 1.19% | 0.17% |
| 过去三年                                       | 85.53%         | 1.77%             | 81.17%           | 1.69%               | 4.36% | 0.08% |
| 过去五年                                       | 46.44%         | 1.55%             | 37.97%           | 1.50%               | 8.67% | 0.05% |

|                                                                                     |                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|
|  |                                  |
| 3.3                                                                                 | 过去三年基金的利润分配情况<br>过去三年本基金无利润分配事项。 |
| 4.1                                                                                 | 基金管理人及基金经理情况                     |

§4 管理人报告

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验  
国联证券股份有限公司（简称“公司”，即国联基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于2000年6月13日正式成立，注册资本1亿元人民币，公司是中国第一家境外持股比例达到49%的基金管理公司，公司在为美国泰康信托有限公司（国开开发投资公司的控股子公司）及瑞丰银行股份有限公司（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机制，以“诚信、创新、专业、客户至上”为经营理念。截止2015年12月底，公司有员工207人，其中118人有硕士以上学历；公司管理53只基金，其中包2只创新型分级基金。

| 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 |        |                                                                                                                       |
| 赵建 | 本基金基金经理 | 2014年4月25日      | —    | 13     | 中国籍,博士。具有基金从业资格,曾任限上海得弘民资有限公司、上海毅利投资有限公司、上海一维科技有限公司,2010年6月加入国投瑞银,现任国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数基金基金经理。 |