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
送出日期:2016年03月28日

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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。

基金托管人中国工商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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银沪深300指数分级		
场内简称	瑞和300		
基金主代码	161207		
基金运作方式	契约型开放式。本基金的基金份额包括本基金之基础份额(简称*瑞和300份额*),本基金之小康份额(简称*瑞和小康份额*)与本基金之远足份额(简称*瑞和远足份额*),其中,瑞和小康份额、瑞和远足份额的基金份额配比始终保持1:1的比率不变,瑞和300份额开通场外与场内两种方式的申购与赎回,瑞和小康份额与瑞和远足份额在深圳证券交易所上市交易。		
基金合同生效日	2009年10月14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	123,056,863.89		
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	2009-11-19		
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞和沪深300指数(场内简称,瑞和300)	国投瑞银瑞和小康沪深300指数(场内简称,瑞和小康)	国投瑞银瑞和远足沪深300指数(场内简称,瑞和远足)
下属分级基金的交易代码	161207	150008	150009
报告期末下属分级基金的份额总额	72,184,769.89	25,436,047.00	25,436,047.00

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深300指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪基准指数。当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如股权分置改革等)导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行间业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	蒋松云
	联系电话	400-880-6868	(010)66105799
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105798

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	http://www.ubssdic.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)	上海市湖滨路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	北京市西城区太平桥大街17号

§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	104,378,068.09	6,245,547.21	-17,422,979.36
本期利润	31,099,305.21	117,153,016.73	-17,849,305.47
加权平均基金份额本期利润	0.2290	0.4030	-0.0446
本期基金份额净值增长率	7.03%	49.85%	-7.56%
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	0.0893	-0.5416	-0.5798
期末基金资产净值	134,800,366.53	416,740,829.92	306,837,040.88
期末基金份额净值	1.0950	1.4060	0.9450

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(例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

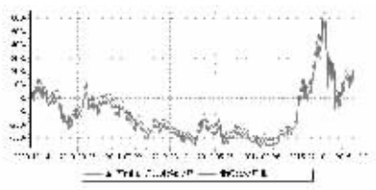
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	18.21%	1.69%	15.66%	1.59%	2.55%	0.10%
过去六个月	-14.69%	2.76%	-15.63%	2.54%	0.94%	0.22%
过去一年	7.03%	2.50%	5.72%	2.36%	1.31%	0.14%
过去三年	48.25%	1.77%	46.00%	1.70%	2.25%	0.07%
过去五年	21.23%	1.56%	19.34%	1.53%	1.89%	0.03%
自基金合同生效日起至今	12.91%	1.56%	17.11%	1.52%	-4.20%	0.04%

注:1.本基金是以沪深300指数为标的指数的被动式指数型基金,对沪深300指数成份股和备选成份股的配置不低于80%,故以95%×沪深300指数收益率+5%×银行间业存款利率作为本基金业绩比较基准。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金合同的约定,在瑞和小康份额、瑞和远足份额的存续期内,本基金(包括瑞和300 份额、瑞和小康份额、瑞和远足份额)不进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人的主要管理基金的经验

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷瑰飞	本基金基金经理	2013年09月26日	-	9	中国籍,博士,具有基金从业资格,曾任职于汇添富基金管理公司,2011年6月加入国投瑞银,现任国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金、国投瑞银金融地产交易型开放式指数基金和国投瑞银中证上游资源产业指数基金(LOF)和国投瑞银新收益灵活配置混合型基金基金经理。
LU RONG QIANG	本基金基金经理、量化投资部总监	2009年10月14日	2015年02月10日	15	澳大利亚籍,硕士,具有基金从业资格,曾任康联吉城投资基金公司投资经理、投资分析师;康邦基金公司资量分析员、投资绩效分析员;美世投资管理顾问公司投资分析师,2008年2月加入国投瑞银,曾任国投瑞银新兴市场基金(QDII-LOF)、国投瑞银瑞福深证100指数分级基金、国投瑞银瑞和沪深300指数分级基金、国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数基金(ETF)及其联接基金基金经理。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银瑞和沪深300指数分级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关联方实施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、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方式弥补操作风险。公司定期、不定期对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差异常,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开展公平交易行为进行监控,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超近于零进行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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年A股市场走势剧烈震荡,金融创新特别是加杠杆的投资行为,进一步加速了居民大类资产配置的转移,市场整体风格倾向于小盘股。上半年A股市场在杠杆资金规模持续加大的背景下走出波澜壮阔的牛市,截至6月中旬,上半年上证综指涨幅超过60%。但年中在去杠杆背景下股灾一触即发,6月底以后市场经历两轮凌厉下跌,2个月左右时间内市场暴跌45%。而日9月之后市场逐渐修复,并在4季度再度走强。从分类指数看,沪深300指数上涨5.88%,创业板指数上涨84.41%。

基金投资操作上,作为指数基金,投资操作以严格控制跟踪误差为主,研究应对成分股调整、成分股停牌替代等机会成本、同时密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及市场出现的结构性机会。

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1.095元,本报告期份额净值增长率为7.03%,同期业绩比较基准收益率为5.72%,基金净值增长率高于业绩基准收益率,主要受报告期内基金的申购赎回活动、指数成分股的调整及部分利息股息收入等综合因素的影响。

报告期内,日均跟踪误差为0.21%,年化跟踪误差为3.42%,符合基金合同约定的跟踪误差不超过0.35%以及4.0%的限制。

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2016年,宏观经济在经历了长时间的疲软之后,有望逐渐企稳,宽松的货币政策和中央力推的"房地产去库存",使得房地产投资可能在2016年出现环比持平或改善,叠加"供给侧改革"对制造业的积极影响,经济增长的回落趋势有望逆转,但是货币宽松周期也逐步进入尾声,宽松货币政策将逐渐让位于利极的财政政策,结合证券市场的微观格局,考虑机构投资者的配置结构偏向小盘股以及股票债券融资规模的扩容,A股市场大概率呈现出宽幅震荡的格局。

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各级与风险控制委员会、估值小组及运营部,各级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以及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。

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,985,386.95	2,780,642.57
其中:支付销售机构的客户维护费	202,615.70	359,029.60

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1.00%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 × 1.00% / 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01月01日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	436,785.14	611,741.37

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%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×0.22% / 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

份额单位:份

项目	本期 2015年01月01日至2015年12月31日			
	国投瑞银瑞和沪深300指数(场内简称:瑞和300)	国投瑞银瑞和小康沪深300指数(场内简称:瑞和小康)	国投瑞银瑞和远足沪深300指数(场内简称:瑞和远足)	合计
基金合同生效日持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	7,508,107.52	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	2,809,894.80	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,318,002.32	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.29%	-	-	-

项目	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日			
	国投瑞银瑞和沪深300指数(场内简称:瑞和300)	国投瑞银瑞和小康沪深300指数(场内简称:瑞和小康)	国投瑞银瑞和远足沪深300指数(场内简称:瑞和远足)	合计
基金合同生效日持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	7,454,638.11	-	-	7,454,638.11
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	53,469.41	-	-	53,469.41
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	7,508,107.52	-	-	7,508,107.52
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.50%	-	-	4.50%

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 2015年01月01日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年01月01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
中国工商银行股份有限公司	7,047,997.32	80,026.84	17,374,222.32	109,067.21

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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(股)	期末成本总额	期末估值总额
000002	万 科A	2015-12-21	重大事项	24.43			80,093	874,704.03	1,956,671.99
000712	锦龙股份	2015-12-25	重大事项	29.12	2016-01-04	28.00	26,100	851,279.90	760,032.00
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项	60.18			10,100	664,694.97	607,818.00
601377	兴业证券	2015-12-29	重大事项	11.00	2016-01-07	9.40	42,982	570,928.70	472,802.00
600271	航天信息	2015-10-12	重大事项	71.46			6,565	163,266.38	469,134.90
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大事项	9.92	2016-02-01	8.93	34,942	255,443.71	346,624.64
600649	城投控股	2015-12-30	重大事项	23.16	2016-01-07	20.84	15,491	130,154.16	358,771.56
601018	宁波港	2015-08-04	重大事项	8.16	2016-02-22	7.34	44,647	150,058.32	364,319.52
600153	建发股份	2015-06-29	重大事项	17.31			21,951	175,206.21	379,971.81
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项	16.69	2016-02-24	15.60	17,796	271,022.99	297,015.24
000876	新 希 望	2015-08-17	重大事项	17.63	2016-03-02	17.09	12,183	214,438.22	214,786.29
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项	25.10			8,060	135,693.05	202,306.00
600873	梅花生物	2015-12-17	重大事项	9.14			19,328	154,733.61	176,657.92
600783	鲁信创投	2015-12-31	重大事项	39.07	2016-01-04	37.60	3,126	59,706.00	122,132.82
600578	京能电力	2015-11-05	重大事项	6.07	2016-02-24	5.49	14,872	82,896.19	90,273.04

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)各层次金融工具公允价值

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119,555,900.95 元,属于第二层次的余额为6,819,317.73 元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次296,332,028.67元,第二层次5,316,271.20元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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。

(iii)第三层次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	126,375,218.68	93.38
	其中:股票	126,375,218.68	93.38
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	7,191,592.11	5.31
7	其他各项资产	1,760,303.13	1.30
8	合计	135,327,113.92	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

8.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	90,984.60	0.07
B	采矿业	4,202,415.96	3.12
C	制造业	40,674,730.42	30.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,906,836.35	3.64
E	建筑业	5,181,046.89	3.84
F	批发和零售业	2,329,760.31	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	5,072,934.48	3.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,349,301.35	5.45
J	金融业	41,557,760.45	30.83
K	房地产业	6,626,241.36	4.92
L	租赁和商务服务业	1,473,149.45	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,159,103.85	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	129,825.38	0.10
R	文化、体育和娱乐业	3,245,137.76	2.41
S	综合	583,639.22	0.43
	合计	124,582,867.83	92.42

8.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	463,868.00	0.34
C	制造业	517,216.45	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	567,392.00	0.42
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	243,874.40	0.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,792,350.85	1.33

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	109,786	3,952,296.00	2.93
2	600016	民生银行	322,900	3,112,756.00	2.31
3	000001	平安银行	211,112	2,531,232.88	1.88
4	601166	兴业银行	148,017	2,526,650.19	1.87
5	601818	光大银行	587,064	2,489,151.36	1.85
6	600036	招商银行	122,686	2,207,121.14	1.64
7	000002	万 科A	80,093	1,956,671.99	1.45
8	600000	浦发银行	94,551	1,727,446.77	1.28
9	601009	南京银行	88,008	1,557,741.60	1.16
10	600030	中信证券	80,428	1,556,382.80	1.15

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002051	中工国际	22,400	567,392.00	0.42
2	002570	贝因美	20,700	309,051.00	0.23
3	000839	中信国安	11,984	243,874.40	0.18
4	600497	驰宏锌锗	21,400	236,256.00	0.18
5	601168	西部矿业	30,800	227,612.00	0.17

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	600016	民生银行	7,296,882.03	1.75
2	601818	光大银行	7,048,118.00	1.69
3	601318	中国平安	5,371,274.00	1.29
4	601169	北京银行	4,756,937.00	1.14
5	601166	兴业银行	4,433,310.00	1.06
6	601939	建设银行	4,007,831.04	0.96
7	601328	交通银行	3,406,953.00	0.82
8	601009	南京银行	3,251,011.47	0.78
9	600036	招商银行	3,224,403.00	0.77
10	601377	兴业证券	3,185,717.91	0.76
11	600030	中信证券	2,899,211.75	0.70
12	000001	平安银行	2,884,058.94	0.69
13	600015	华夏银行	2,465,822.00	0.59
14	600060	海信电器	2,458,867.00	0.59
15	600369	西南证券	2,378,083.00	0.57
16	000776	广发证券	2,257,025.00	0.54
17	600383	金地集团	2,136,070.00	0.51
18	600837	海通证券	2,117,508.00	0.51
19	000858	五 粮 液	2,081,542.00	0.50
20	600000	浦发银行	1,909,590.00	0.46

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