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

国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金

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。

§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	本基金将实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。 本基金类别资产配置比例遵循以下原则： (1)股票投资占基金资产的30-80%； (2)权证投资占基金资产的比例不高于3%； (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%。
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	田青
	联系电话	400-880-6868	010-67595096
	电子邮箱	service@ubssdic.com	tianqing1.zh@ccb.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	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

§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益收入、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减去期末公允价值变动收益的数额(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类费用(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。

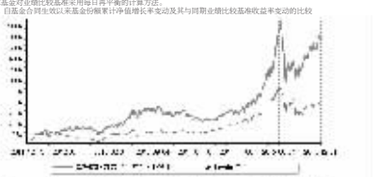
3.2 基金净值表现

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未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")，即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4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流程,以"诚信、信任、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300人,其中118人具有硕士或博士学位;公司管理93只基金,其中包括52只创新型分级基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会

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月加入国投瑞银研发部,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。现任国投瑞银融华债券、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:(1)职务栏期内离任日期均指公司作出决定的正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券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、忠实不欺的原则,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,基金操作合法合规,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 公平交易制度和执行情况

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控制以下原则:

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.当不同资产类别人利益发生冲突时,以公平的original不同的资产类别人;

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.公平交易的实现需要所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易均实现公平公开原则,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.以系统刚性控制为优先措施。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程顺序、控制规则或逻辑关系,对触及规则或逻辑关系的操作,系统会自动执行警告、强制禁止等控制措施或不同意见的提示,如:符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令,系统会自动合并为一笔交易并按中签概率原则分配基金份额;对触及规则或逻辑关系的操作,系统会自动执行警告或强制禁止,并记录操作信息,以便事后稽核。

2.加强信息披露和提示外部监督。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。公司定期按受外部审计的相关,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,将公平交易制度完善程度作为评价内容之一。公司每季度会向证券投资组合经理、督察长、投资总监等主要的公平交易制度执行情况,并对特定交叉交易、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析不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,并会就证券交易所等对公司异常交易行为进行监控,对于发现的公平交易和利益输送,证监会有权采取相应的监管措施。

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。通过对投资分析方法的甄别、分析评估和信息披露来加强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、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)公平交易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稽核环节或交易价差异常,将重新修正公平交易的相关参数和分析模型,并对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5.加强信息披露和提示外部监督。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。公司定期按受外部审计的相关,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,将公平交易制度完善程度作为评价内容之一。公司每季度会向证券投资组合经理、督察长、投资总监等主要的公平交易制度执行情况,并对特定交叉交易、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析不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,并会就证券交易所等对公司异常交易行为进行监控,对于发现的公平交易和利益输送,证监会有权采取相应的监管措施。

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集中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,宏观经济调结构与深化改革并行,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,国资改革纲领推进,反腐力度保持高压态势。

2015年对于资本市场而言,是值得纪念的"本年"。"改革年"、"杠杆年"、"共同演绎了一场惊心动魄的牛市"。

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。但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跑赢上市场上涨的节奏,下半年有少量的风险收益比,总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%。

报告期末基金份额净值为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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

2016年国内宏观经济依然难见明显起色,货币政策持续宽松,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面方面的内容,一般再提是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,我们需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年的收益率期望。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;估值小组负责期初每行内估值政策、议定估值政策方案及特别的估值程序的相关事项;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,设立基金估值核算共同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估改采用集体讨论机制,基金经理作为估值小组成员,对本基金持有证券的交易情况、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期共实现收益27,073,693.18元,期末可供分配利润为36,116,892.96元。

本基金本报告期因无利润可分配事项。

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。

4.9 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,完全恪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,本托管人根据国家有关规定、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损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期未实施现金分配。

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
资 产:			
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
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
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
所有者权益:			
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
一、收入		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
减:二、费用		2,263,997.32	2,349,188.27
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
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		25,310,611.70	6,710,306.44
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		25,310,611.70	6,710,306.44

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(基金净值)	37,223,283.78	6,784,115.07	44,007,398.85
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
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
项 目	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

附注项目: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")经中国证监会监督管理委员会以下简称"中国证监会")证监许可[2011]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1,290,832.57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《关于核准"深交所字[2012]第45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的托管业务转其份额至场内进行上市流通。

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。本基金的投资组合比例为:股票资产为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净值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%×中证新兴产业指数+45%×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信息披露内容与格式准则第1号《招募说明书(更新)》》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例(2.7.4.3.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(aa)第二层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金无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)。

(ab)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,最左资产负债表日本基金无需披露的其他重要事项。

§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	联明股份	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