（上接B99版）

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。

(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。

§9 年度财务报表(国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金（转型前））

报告期（2015年01月01日-2015年08月13日）

9.1 资产负债表（转型前）

会计主体：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

报告截止日：2015年08月13日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年08月13日	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	3,865,803,875.30	318,422,945.06
结算备付金	12,088,244.67	-
存出保证金	173,079.66	103,673.98
交易性金融资产	6,042,170,562.00	8,317,994,528.03
其中：股票投资	6,042,170,562.00	8,167,964,528.03
基金投资	-	-
债券投资	-	150,030,000.00
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	667,669,180.25	15,252,132.22
应收利息	767,925.49	7,214,575.07
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	10,588,672,867.37	8,658,987,854.36
负债和所有者权益	本期末 2015年08月13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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,621,648.09	7,071,309.02
应付托管费	796,762.59	1,555,687.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,357,091.50	1,090,315.51
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,563,818.76	1,777,433.46
负债合计	12,339,320.94	11,494,745.98
所有者权益：		
实收基金	11,859,574,547.56	11,902,703,016.90
未分配利润	-1,283,241,001.13	-3,255,209,908.52
所有者权益合计	10,576,333,546.43	8,647,493,108.38
负债和所有者权益总计	10,588,672,867.37	8,658,987,854.36

注：报告截止日2015年8月13日(基金转型前日)，基金份额净值1.450元，基金份额总额7,291,614,534.73份，其中国投瑞银瑞福优先封闭份额3,645,807,265.45份，国投瑞银瑞福进取封闭份额3,645,807,269.28份。

9.2 利润表（转型前）

会计主体：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

本报告期：

单位：人民币元

项 目	本期2015年01月01日-2015年08月13日	上年度可比期间2014年01月01日至2014年12月31日
一、收入	2,135,144,543.80	2,099,293,598.81
1.利息收入	7,123,255.12	5,598,674.41
其中：存款利息收入	1,784,331.83	2,198,792.22
债券利息收入	5,338,923.29	3,399,882.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,311,846,312.84	-219,515,720.30
其中：股票投资收益	2,210,350,821.56	-312,599,263.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-850,540.00	33,750.00
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	102,346,031.28	93,049,793.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-184,064,541.99	2,312,934,820.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	239,517.83	275,824.17
减：二、费用	96,030,927.34	87,764,660.29
1.管理人报酬	64,955,311.67	64,737,815.07
2.托管费	14,290,168.54	14,242,319.40
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	15,205,137.06	7,024,275.02
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	1,580,310.07	1,760,250.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,039,113,616.46	2,011,528,938.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,039,113,616.46	2,011,528,938.52

9.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型前）

会计主体：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

本报告期：

单位：人民币元

项 目	本期2015年01月01日-2015年08月13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）	11,902,703,016.90	-3,255,209,908.52	8,647,493,108.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,039,113,616.46	2,039,113,616.46
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）	-43,128,469.34	-67,144,709.07	-110,273,178.41
其中：1.基金申购款	220,488,259.88	343,267,922.28	563,756,182.16
2.基金赎回款	-263,616,729.22	-410,412,631.35	-674,029,360.57
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）	11,859,574,547.56	-1,283,241,001.13	10,576,333,546.43
项 目	上年度可比期间2014年01月01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）	12,258,656,646.43	-5,415,214,820.00	6,843,441,826.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,011,528,938.52	2,011,528,938.52
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）	-355,953,629.53	148,475,972.96	-207,477,656.57
其中：1.基金申购款	1,660,423,396.24	277,719,874.13	1,938,143,270.37
2.基金赎回款	-2,016,377,025.77	-129,243,901.17	-2,145,620,926.94
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）	11,902,703,016.90	-3,255,209,908.52	8,647,493,108.38

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

9.4 报表附注（转型前）

9.4.1 基金基本情况

国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金是根据原国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金(以下简称"国投瑞银瑞福基金")基金份额持有人大会2012年6月8日决议通过的《关于国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金合同延期及修改相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可字[2012]880号《关于核准国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原国投瑞银瑞福基金转型而来。原国投瑞银瑞福基金存续期限至2012年7月16日止。自2012年7月17日起，原国投瑞银瑞福基金更名为国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")，《国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《国投瑞银瑞福深证100 指数分级证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《国投瑞银瑞福深证100 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即优先级基金份额(以下简称"瑞福优先份额")和进取级基金份额(以下简称"瑞福进取份额")。本基金自2012年7月17日至2012年8月13日为过渡期。本基金过渡期结束后的下一工作日开始为本基金分级运作期的起始日；基金分级运作期为3年。基金分级运作期届满后，本基金转换为"国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)"。在分级运作期内，当瑞福进取份额净值小于或等于0.25元或瑞福优先份额少于5000万份时，本基金将提前转型为"国投瑞银瑞福深证100指数型证券投资基金(LOF)"。瑞福优先份额在分级运作期开始后每满六个月时开放一次，接受投资者的集中申购与赎回，瑞福优先份额集中申购与赎回的开放日为分级运作期开始后每满六个月的最后一日(如该日为非工作日，则为下一个工作日)；瑞福进取份额封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回，封闭期为本基金的分级运作期。在瑞福优先份额的每次开放日，本基金的基金管理人对瑞福优先份额进行基金份额折算，瑞福优先份额的基金份额净值调整为1.000 元，基金份额持有人持有的瑞福优先份额数按折算比例相应调整。经深圳证券交易所申请，瑞福进取份额于2012年8月17日在深圳证券交易所复牌。

根据《瑞福深证100指数分级基金分级运作期届满基金名称变更的公告》，本基金分级运作期已于2015年8月13日到期，自2015年8月14日起，本基金的基金名称变更为国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银瑞福深证100 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是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(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于深证100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差计值不低于基金资产净值的90%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。本基金的业绩比较基准为：95% ×深证100 价格指数收益率＋5% × 银行活期存款利率(税后)。

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3月25日批准报出。

9.4.2 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》、《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注9.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

9.4.3 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8月13日的财务状况以及2015年1月1日至2015年8月13日(基金转型前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

9.4.4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。

9.4.5 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。

9.4.6 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》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，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额。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。

9.4.7 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、瑞福优先封闭份额基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行	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（UBS AG）	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。

9.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

9.4.8.1 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。

9.4.8.2 关联方报酬

9.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2015年01月01日-2015年08月13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	64,955,311.67	64,737,815.07
其中：支付销售机构的客户维护费	3,353,415.36	6,311,159.48

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，在分级运作期内按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，在转换为上市开放式基金(LOF)之后按前一日基金资产净值0.75%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 × 约定年费率/当年天数。

9.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2015年01月01日-2015年08月13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	14,290,168.54	14,242,319.40

注：支付基金托管人 中国工商银行的托管费，在分级运作期内按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，在转换为上市开放式基金(LOF)之后按前一日基金资产净值0.15%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 ×约定年费率/ 当年天数。

9.4.8.3 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。

9.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

9.4.8.4.1 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 (国投瑞银瑞福优先封闭)	本期2015年01月01日-2015年08月13日	上年度可比期间2014年01月01日至2014年12月31日
期初持有的基金份额	11,958,529.72	11,272,061.84
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	361,704.57	686,467.88
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,320,234.29	11,958,529.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.34%	0.33%

份额单位：份

项目 (国投瑞银瑞福进取封闭)	本期2015年01月01日-2015年08月13日	上年度可比期间2014年01月01日至2014年12月31日
期初持有的基金份额	38,099,267.00	38,099,267.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	38,099,267.00	38,099,267.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.05%	1.05%

9.4.8.4.2 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未无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

9.4.8.5 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-2015年08月13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	3,865,803,875.30	1,763,428.43	318,422,945.06	2,051,978.00

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。

9.4.8.6 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。

9.4.8.7 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。

9.4.9 期末（2015年08月13日）本基金持有的流通受限证券

9.4.9.1 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。

9.4.9.2 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
002069	獐子岛	2015-06-01	非公开发行	19.76	2015-09-08	17.18	1006860	21,093,088.55	19,895,553.60
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事项	16.42	2015-11-18	15.10	1938892	30,324,083.06	31,836,606.64
000009	中国宝安	2015-07-07	重大事项	10.68	2015-08-18	11.75	4599045	36,405,514.42	49,117,800.60
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	33.68			4304090	62,164,278.73	144,961,751.20
000630	铜陵有色	2015-03-09	非公开发行	8.86	2015-10-23	3.60	5614592	25,423,537.72	49,745,285.12
000709	河北钢铁	2015-06-30	非公开发行	7.00	2015-08-24	6.30	15939995	38,339,153.34	111,579,965.00
000712	锦龙股份	2015-07-08	非公开发行	21.75	2015-10-16	23.93	1780780	59,883,928.41	38,731,965.00
000768	中航飞机	2015-08-12	重大事项	38.12	2015-08-19	34.31	2648404	21,457,012.17	100,957,160.48
000778	新兴铸管	2015-06-15	非公开发行	9.55	2015-09-15	11.63	8235132	34,586,134.21	78,645,510.60
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	16.84	2015-08-31	18.68	4631757	32,569,235.56	77,998,787.88
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	20.20	2015-12-28	22.50	3743308	25,931,490.71	75,614,821.60
000858	五粮液	2015-07-29	非公开发行	25.73	2015-11-02	24.93	6430482	222,896,389.21	165,456,301.86
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	15.88	2015-09-08	22.05	2874647	47,063,956.23	45,649,394.36
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项	27.16	2015-11-13	38.55	4337458	57,663,212.43	117,805,359.28
002030	达安基因	2015-07-20	非公开发行	43.90	2015-10-14	39.60	1766253	32,592,375.52	77,538,506.70
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	41.50	2015-08-28	34.07	1472568	25,918,482.12	61,111,572.00
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项	32.53	2015-09-30	39.92	1542870	73,304,787.57	50,189,561.10
002415	海康威视	2015-07-09	重大事项	44.17	2015-09-09	30.20	4279829	73,144,408.77	189,040,046.93
300027	华谊兄弟	2015-07-27	重大事项	39.58	2015-10-23	39.00	3083881	86,756,525.30	122,060,009.98
300058	蓝色光标	2015-08-05	重大事项	15.30	2015-11-13	15.73	4966351	66,120,378.73	75,985,170.30
300070	碧水源	2015-07-21	非公开发行	47.50	2015-08-17	52.25	2103669	46,289,983.60	99,924,277.50
300315	掌趣科技	2015-08-07	重大事项	16.32	2015-08-26	12.83	3871469	41,259,935.07	63,182,374.08

注：1、本基金截至2015年8月13日(基金转型前日)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。

2、本基金持有的停牌股票“招商地产”（代码：000024）于2015年9月18日公告吸收合并为“招商蛇口”（代码：001979），吸收合并后共转成招商蛇口1,117,784股，并于2015-12-30日上市流通，开盘价23.90元。

9.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

9.4.9.3.1 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。

9.4.9.3.2 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。

9.4.10 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8月13日(基金转型前日)，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4,195,142,780.19元，属于第二层次的余额为1,847,027,781.81元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次7,752,316,859.35元，第二层次565,677,668.68元，无属于第三层次的余额)。

(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8月13日(基金转型前日)，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。

§10 投资组合报告(国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）（转型后））

报告期（2015年08月14日-2015年12月31日）

10.1 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	940,357,798.19	93.13
	其中：股票	940,357,798.19	93.13
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	66,560,623.89	6.59
7	其他各项资产	2,806,998.00	0.28
8	合计	1,009,725,420.08	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。

10.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

10.2.1 报告期末（指数投资）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	1,651,214.00	0.16
B	采矿业	7,459,664.00	0.74
C	制造业	470,304,257.01	46.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,217,289.92	0.42
E	建筑业	2,962,648.00	0.30
F	批发和零售业	25,804,161.23	2.57
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	128,543,172.01	12.82
J	金融业	133,531,407.50	13.32
K	房地产业	117,855,330.57	11.75
L	租赁和商务服务业	574.47	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,547,145.89	2.05
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	19,213,945.59	1.92
S	综合	8,266,988.00	0.82
	合计	940,357,798.19	93.79

10.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票

10.3 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(元)	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科A	2,392,794	58,455,957.42	5.83
2	000651	格力电器	1,586,409	35,456,241.15	3.54
3	000876	新 希 望	1,802,450	31,777,193.50	3.17
4	300059	东方财富	523,071	27,215,384.13	2.71
5	002450	康得新	647,552	24,671,731.20	2.46
6	000001	平安银行	2,056,441	24,656,727.59	2.46
7	001979	招商蛇口	1,117,784	23,316,974.24	2.33
8	000725	京东方A	7,583,476	22,522,923.72	2.25
9	000783	长江证券	1,710,939	21,249,862.38	2.12
10	300104	乐视网	331,721	19,962,969.78	1.99

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。

10.3.1 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 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	000001	平安银行	82,233,996.62	1.20
2	000651	格力电器	72,079,867.69	1.06
3	000002	万 科A	64,384,404.91	0.94
4	000024	招商地产	49,668,076.40	0.73
5	000333	美的集团	45,247,606.31	0.66
6	000728	国元证券	43,827,750.60	0.64
7	002142	宁波银行	43,719,275.40	0.64
8	000725	京东方A	43,526,288.00	0.64
9	300059	东方财富	41,598,432.29	0.61
10	000100	TCL 集团	41,140,400.90	0.60
11	000046	泛海控股	41,014,165.88	0.60
12	000776	广发证券	40,298,541.62	0.59
13	002241	歌尔声学	39,350,060.64	0.58
14	002594	比亚迪	37,661,313.10	0.55
15	000783	长江证券	37,110,629.64	0.54
16	300104	乐视网	36,205,781.78	0.53
17	000402	金 融 街	34,630,336.97	0.51
18	002450	康得新	33,803,645.83	0.50
19	000166	申万宏源	32,837,485.39	0.48
20	002415	海康威视	30,523,286.35	0.45

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。

10.4.2 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	000002	万 科A	233,693,834.24	3.42
2	002024	苏宁云商	192,866,148.26	2.83
3	000651	格力电器	187,541,089.89	2.75
4	000001	平安银行	178,031,244.75	2.61
5	002415	海康威视	155,367,724.81	2.28
6	000024	招商地产	149,457,537.03	2.19
7	000725	京东方A	147,856,890.96	2.17
8	000858	五 粮 液	147,102,668.31	2.15
9	000917	电广传媒	128,925,474.09	1.89
10	000333	美的集团	126,827,109.85	1.86
11	000776	广发证券	115,811,492.47	1.70
12	300027	华谊兄弟	109,119,895.84	1.60
13	300059	东方财富	105,770,321.53	1.55
14	000166	申万宏源	82,150,375.90	1.20
15	002030	达安基因	78,980,713.64	1.16
16	300058	蓝色光标	78,800,860.24	1.15
17	000783	长江证券	76,921,067.32	1.13
18	300070	碧水源	76,867,135.40	1.13
19	002450	康得新	75,594,079.49	1.11
20	300104	乐视网	75,064,457.60	1.10

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。

10.4.3 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

买入股票成本 成交 总额	1,506,695,881.22
卖出股票收入 成交 总额	5,462,669,949.53

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。

10.5 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资产。

10.6 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资产。

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

10.8 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。

10.9 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。

10.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

10.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，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对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申赎时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

10.12 投资组合报告附注

10.12.1 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。

10.12.2 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。

10.12.3 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	2,696,053.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,699.14
5	应收申购款	97,245.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,806,998.00

10.12.4 期末持有的处于转股期