

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
报告送出日期: 二〇一六年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责, 严格按照法律法规和行业自律规范运作基金, 切实履行受托人义务, 维护基金份额持有人的合法权益, 防范和化解风险, 保障基金财产的安全。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, 也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金招募说明书, 基金合同中基金产品资料概要等基金文件。本报告中财务数据未经审计。
本报告自2016年7月1日起生效, 30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	国投瑞银中证下游消费与服务指数(LOF)
场内简称	国投消费
基金代码	161213
交易代码	161213(前端) 161213(后端)
基金运作方式	上市型开放式
基金合同生效日	2016年12月16日
招募说明书公告日期	85.667.295.437
跟踪标的基金简称	中证下游消费与服务产业指数
投资策略	本基金通过动量的指数化投资管理, 实现对中证下游消费与服务产业指数的有效跟踪。 本基金为被动式指数基金, 采用完全复制的指数方法跟踪标的指数, 跟踪标的指数的表现, 力争实现基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率相接近。 本基金为被动式指数基金, 采用完全复制的指数方法跟踪标的指数, 跟踪标的指数的表现, 力争实现基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率相接近。 本基金为被动式指数基金, 采用完全复制的指数方法跟踪标的指数, 跟踪标的指数的表现, 力争实现基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率相接近。
投资范围	本基金为股票型基金, 属于较高风险、较高预期收益的基金品种, 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。
业绩比较基准	95%×中证下游消费与服务产业指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金, 属于较高风险、较高预期收益的基金品种, 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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标		3.2 主要财务指标和基金净值表现	
单位: 人民币元			
主要财务指标		报告期	
		(2016年4月1日至2016年6月30日)	
1.本期已实现收益	141,912.64		
2.本期利润	1,123,366.42		
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.10228		
4.期末基金资产净值	61,401,160.65		
5.期末基金份额净值	1.302		

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. 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)计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

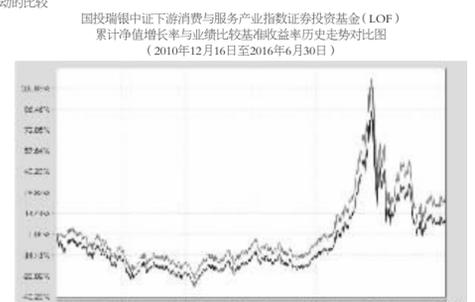
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.86%	1.30%	1.37%	2.07%	0.69%

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, 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)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. 2016年基金合同生效以来基金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 自基金合同生效以来基金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

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF) 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2016年12月16日至2016年6月30日)



注: 本基金建仓期为自基金合同生效之日起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规定。

4. 基金管理人

4.1 基金管理人(或基金经)简介

证券代码: 002429 证券简称: 兆驰股份 公告编号: 2016-077
深圳市兆驰股份有限公司
关于召开2016年第五次临时股东大会的通知

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整, 没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市兆驰股份有限公司(以下简称“公司”)第四届董事会第二次会议审议通过《关于提议召开2016年第五次临时股东大会的议案》, 定于2016年8月5日下午14:30召开2016年第五次临时股东大会, 本次会议的召集程序符合《公司法》等有关法律法规和规范性文件以及《公司章程》的相关规定, 现将本次会议的有关事项通知如下:

一、召开会议的基本情况

(一)会议召集人: 公司董事会
(二)会议登记日: 2016年7月29日(星期五)

(三)会议召开时间: 2016年8月5日(星期五)下午14:30
(四)网络投票时间: 2016年8月4日至8月5日, 其中通过深圳证券交易所交易系统网络投票的时间为2016年8月5日上午9:30-11:30, 下午13:00-15:00; 通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的时间为2016年8月5日11:30-15:00, 下午13:00-15:00。

(五)会议审议事项: 本次会议采用现场表决与网络投票相结合的方式, 公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统(http://wlp.cninfo.com.cn)向全体股东提供网络投票平台, 股东可以在网络投票时间内通过深圳证券交易所交易系统或互联网投票系统行使表决权。

(六)会议地点: 深圳市龙岗区南湾街道李朗社区李朗一区兆驰创新产业园3号楼6楼会议室。

(七)参加股东大会的方式: 公众股东可选择现场投票(现场投票以委托他人代为投票)或网络投票中的一种或多种方式; 同一表决权只能选择现场投票, 以第一次投票表决结果为准。

(八)出席对象: 2016年7月29日15:00收市时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东均有权以本人名义或委托他人出席本次股东大会及参加表决, 不能亲自出席的股东可书面委托代理人出席(受托人必须是本公司股东)。

一、公司董事会、高级管理人员;
二、会议聘请的见证律师;

三、会议审议事项

1.《关于修订<公司章程>的议案》;
2.《关于修订<公司管理制度的议案》;

三、会议地点: 深圳市兆驰股份有限公司第四届董事会第二次会议审议通过, 详细内容见2016年7月20日刊载于《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)的《第四届董事会第二次会议决议公告》(公告编号: 2016-075)、《第四届董事会第二次会议决议公告》(公告编号: 2016-076)。

上述议案属于涉及影响中小投资者利益的重大事项, 公司将针对中小投资者(中小投资者是指指下除大股东以外的其他股东); 上市公司董事、监事、高级管理人员; ②单独或者合计持有上市公司5%以上股份的股东)单独或合并, 并跟踪统计结果进行公开披露。

三、网络投票系统操作

(一)登记时间: 2016年8月1日至2016年8月2日上午9:00至12:00; 下午14:00至17:00。
(二)登记方式:

1.自然人股东携带本人身份证、证券账户卡进行登记, 委托他人出席会议的, 须持本人身份证、委托人身份证、授权委托书及证券账户卡进行登记;
2.法人股东由法定代表人出席会议的, 需持营业执照复印件、本人身份证、法定代表人身份证、证券账户卡进行登记; 由法定代表人授权他人出席会议的, 需持本人身份证、法定代表人身份证、授权委托书、营业执照复印件、授权委托书及证券账户卡进行登记;
3.异地股东可以电话、邮件等方式进行登记。

(三)登记地点及信函邮寄地址: 深圳市龙岗区南湾街道李朗社区李朗一区兆驰创新产业园3号楼6楼董事会办公室(信函上请注明“出席股东大会”字样)。

邮政编码: 518112
电子邮箱: LSG@stcn.com
传真号码: 0755-33614256

四、参加网络投票的具体操作流程

本次会议公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统(http://wlp.cninfo.com.cn)向全体股东提供网络投票平台, 股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统参加投票, 网络投票的具体操作程序如下:

一、通过深圳证券交易所交易系统进行投票的程序

1.投票代码: 362429
2.投票简称: 兆驰投票
3.投票时间: 2016年8月5日的交易时间, 即9:30-11:30和13:00-15:00;
4.股东可以选择以下两种方式之一通过交易系统投票:

(1)通过证券公司交易终端进行投票;
(2)通过深圳证券交易所互联网投票系统进行投票。

5.通过证券公司交易终端投票程序: 登录交易系统, 选择“网络投票”功能按钮;
(3)选择会议进入投票界面;

(4)根据提示内容点击“同意”、“反对”或“弃权”; 对累积投票议案填写选举票数。

6.通过证券公司交易终端以指定投票代理买卖人委托进行投票的操作程序:
(1)在投票当日, “智能理财”响应“收盘”提示的即为本次股东大会决议的议案总数。

(2)进行网络投票时, 系统提示“本人”即为本次股东大会决议的议案总数。

(3)在“委托投票”项下填列股东大会决议序号, 100.00元代表议案1, 1.00元代表议案2, 依此类推, 每一议案以相应的委托价格列明。股东大会议案和对应的委托价格如下:

序号	议案名称	委托价格
1	议案1	100.00
2	议案2	1.00
3	议案3	2.00

注: 1.在“委托投票”项下填列表决意见, 1代表同意, 2代表反对, 3代表弃权, 表决意见对应“委托数量”如下:

表决意见类型	委托数量
同意	1
反对	2
弃权	3

附件一: 参加网络投票的具体操作流程

本次会议公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统(http://wlp.cninfo.com.cn)向全体股东提供网络投票平台, 股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统参加投票, 网络投票的具体操作程序如下:

一、通过深圳证券交易所交易系统进行投票的程序

1.投票代码: 362429
2.投票简称: 兆驰投票
3.投票时间: 2016年8月5日的交易时间, 即9:30-11:30和13:00-15:00;
4.股东可以选择以下两种方式之一通过交易系统投票:

(1)通过证券公司交易终端进行投票;
(2)通过深圳证券交易所互联网投票系统进行投票。

5.通过证券公司交易终端投票程序: 登录交易系统, 选择“网络投票”功能按钮;
(3)选择会议进入投票界面;

(4)根据提示内容点击“同意”、“反对”或“弃权”; 对累积投票议案填写选举票数。

6.通过证券公司交易终端以指定投票代理买卖人委托进行投票的操作程序:
(1)在投票当日, “智能理财”响应“收盘”提示的即为本次股东大会决议的议案总数。

(2)进行网络投票时, 系统提示“本人”即为本次股东大会决议的议案总数。

(3)在“委托投票”项下填列股东大会决议序号, 100.00元代表议案1, 1.00元代表议案2, 依此类推, 每一议案以相应的委托价格列明。股东大会议案和对应的委托价格如下:

序号	议案名称	委托价格
1	议案1	100.00
2	议案2	1.00
3	议案3	2.00

注: 1.在“委托投票”项下填列表决意见, 1代表同意, 2代表反对, 3代表弃权, 表决意见对应“委托数量”如下:

表决意见类型	委托数量
同意	1
反对	2
弃权	3

附件二: 2016年第五次临时股东大会授权委托书

深圳市兆驰股份有限公司 董事会
二〇一六年七月二十日

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)

2016 第二季度报告

2016年6月30日

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
赵婕	本基金基金经理	2014-04-25	13	中国籍, 博士, 具有基金从业资格, 曾任上海证券期货投资咨询有限责任公司, 上海一统科技股份有限公司, 2010年6月加入国投瑞银, 曾任国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)基金经理, 现担任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。

2 报告期内, 本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)基金合同》等有关规定, 本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实履职的原则, 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内, 本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度, 通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现, 以确保本基金管理人旗下各投资组合在投资、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得到有效的监督, 形成了有效的公平交易体系。本报告期, 本基金管理人各项公平交易制度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。

4.3.2 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超过该证券当日总成交量3%的情况。

4.4 报告期内本基金投资范围和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2016年上半年, 在经历了持续的货币宽松和各个地方对房地产的支持的政策之后, 房地产销售回暖, 新开工由负转正, 宏观经济有企稳态势, 1月份全球金融市场震荡, 中国A股也难以幸免, 2、3月份市场逐步企稳, 我们理解, 1月份的下跌源于市场本身高估值对于全球流动性收缩等利空因素的敏感反应, 同时风险也得到较大的释放。

基金投资操作上, 作为指数基金, 投资操作上以严格控制跟踪误差为主, 研究对成分股调整、成份股替换替代机会成本, 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 报告期内基金的投资表现

截止本报告期末, 本基金份额净值为1.262元, 本报告期份额净值增长率为1.86%, 同期业绩比较基准收益率为-0.21%, 基金净值增长率高于业绩比较基准率, 主要受指数成分股调整、基金的申购赎回活动、部分利息收入及扣减费率等综合因素的影响。

报告期内, 跟踪误差绝对值的平均值为0.19%, 年化跟踪误差率为3.75%, 符合基金合同约定的跟踪误差绝对值的平均值不超过0.35%以及年化跟踪误差率不超过4.0%的限制。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的展望
展望未来, 在经济出现企稳反弹、通胀前景下, 我们预计货币政策将趋于中性, 准将进一步宽松的空间, 股票市场在经历了1季度的大幅调整后, 股票市场的风险得到一定程度的释放, 但外部国际形势及国内政策的变化不容忽视, 美国股市数据的走势以及美联储加息预期的引导对汇率的影响也依然值得关注。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,132,453.23	92.29
2	其中: 股票	57,132,453.23	92.29
3	固定收益投资	-	-
4	其中: 债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他各项资产	4,761,647.97	7.69
10	其他负债	12,489.65	0.02
11	合计	61,906,590.85	100.00

注: 1. 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。
2. 本报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	686,247.13	1.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,008,963.82	47.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,071,210.00	47.24
E	建筑业	3,073,131.00	5.01
F	批发和零售业	4,159,170.75	6.77
G	交通运输、仓储和邮政业	110,418.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,252,042.76	18.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,969,621.32	9.61
L	租赁和商务服务业	2,146,424.64	3.51
M	科学研究和技术服务业	184,520.14	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,224,735.45	1.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	425,120.22	0.69
R	文化、体育和娱乐业	3,463,655.71	5.64
S	综合	-	-
合计		61,246,261.29	100.00

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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

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	600519	贵州茅台	8,567.00	2,560,878.64	4.07
2	000651	格力电器	85,548.00	1,888,044.36	3.07
3	600887	伊泰股份	102,412.00	1,707,208.04	2.78
4	000333	美的集团	54,028.00	1,281,544.16	2.09
5	600104	上汽集团	55,888.00	1,133,388.82	1.85
6	600888	鲁南钒业	32,156.00	1,040,610.68	1.70
7	600276	诺德股份	23,982.00	961,910.02	1.57
8	301014	奇安信	18,700.00	803,670.00	1.31
9	300059	东方财富	30,409.00	804,287.80	1.30
10	600518	顺丰控股	52,238.00	793,495.22	1.29

5.3.2 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债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	102219	国开债016	16,150.00	178,457.50	0.29
2	300668	华泰转债	329.00	83,730.50	0.14
3	603779	航电转债	1,125.00	47,265.00	0.08
4	002798	帝力转债	438.00	37,974.60	0.06
5	603737	三钢转债	181.00	30,913.44	0.05

5.3.3 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资产支持证券投资明细

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.3.4 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

注: 本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.3.5 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权证投资明细

注: 本基金本报告期末未持有权证投资。

5.3.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注: 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注: 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.4 投资组合报告附注

5.4.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.4.2 本基金投资的前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.4.3 本基金投资的前十名债券中, 没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

5.4.4 本基金持有的资产支持证券, 其投资符合法律法规及基金合同的约定。

5.4.5 本基金持有的权证, 其投资符合法律法规及基金合同的约定。

5.4.