国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

（原国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金转型）

【2015】第三季度报告

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：2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人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》的规定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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相关公告。

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)由国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金于2015年8月14日转型而成，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》的有关规定，国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金的三年分级运作期于2015年8月13日届满，在分级运作三年期届满，无需召开基金份额持有人大会，基金日动转换为上市开放式基金(LOF)，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)”，转换为上市开放式基金(LOF)时，瑞福优先份额资产以现金形式给付，瑞福进取份额资产则转入国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)，转换为上市开放式基金(LOF)后，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序不变。

相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn)及本公司网站。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告中国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)的报告期自2015年8月14日(基金合同生效日)起至2015年9月30日止，国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金的报告期自2015年7月1日起至2015年8月13日止。

§2 基金产品概况

转型后：国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

基金简称	国投瑞银深证100指数(LOF)
场内简称	深证100
基金主代码	161227
交易代码	161227
基金运作方式	上市契约型开放式
基金转型生效日	2015年8月14日
报告期末基金份额总额	1,702,798,638.45份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，实现对深证100价格指数的有效跟踪，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	本基金投资于深证100指数成份股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合计值不低于基金资产净值的95%；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和建议股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。 当预期指数成份股调整和或份额将发生分红、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，以有效复制和跟踪指数。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的规模收益和规模风险高于货币市场基金、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

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

基金简称	国投瑞银瑞福分级封闭
基金主代码	121099
基金运作方式	契约型证券投资基金
基金合同生效日	2012年08月13日
报告期末基金份额总额	7,291,614,534.74份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，实现对深证100价格指数的有效跟踪，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	本基金投资于深证100指数成份股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合计值不低于基金资产净值的95%；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和建议股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。 当预期指数成份股调整和或份额将发生分红、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，以有效复制和跟踪指数。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的规模收益和规模风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞福优先封闭 国投瑞银瑞福进取封闭
下属分级基金的场内简称	- 瑞福进取
下属分级基金的交易代码	121007 150001
报告期末下属分级基金的份额总额	3,645,807,265.45 3,645,807,269.28

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

转型后：国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年8月14日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	453,255,871.10
2.本期利润	-1,533,613,363.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3855
4.期末基金资产净值	1,280,591,799.85
5.期末基金份额净值	0.752

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年8月13日)
1.本期已实现收益	1,647,852,030.66
2.本期利润	-1,075,509,597.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1475
4.期末基金资产净值	10,576,333,546.43
5.期末基金份额净值	1.450

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、基金交易费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.3 其他指标

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

单位：人民币元

其他指标	报告期(2015年7月1日-2015年8月13日)
期末瑞福优先与瑞福进取两级基金份额配比	1:1.000000001
期末瑞福优先份额净值	1.029
期末瑞福优先累计份额净值	1.193
期末瑞福进取份额净值	1.872
期末瑞福进取累计份额净值	1.872
瑞福优先的约定年化收益率	5.75%

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
赵建	本基金基金经理	2013年9月26日	-	12	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于汇添富基金管理有限公司，2011年4月加入国投瑞银，现任国投瑞银瑞福深证100指数分级基金、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资源指数基金(LOF)基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定并以公告之日。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(试行)》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的说明

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《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实保护基金份额持有人的利益的原则，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

本报告期内，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研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资执行方的监控、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在有效执行的基础上，进一步加强了对公平交易的监督力度，形成了有效的公平交易体系。

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单笔交易所涉及的证券的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年3季度，市场先后经历了二轮快速下跌的过程，引发的因素分别归结于三方面，第一轮市场下跌源于杠杆资金的不断加大所引起的A股“踩踏”事件，第二轮市场下跌源于人民币迅速贬值带来的资金流动压力，第三轮市场下跌源于海外配资清理结果，从目前市场情况来看，去杠杆最猛烈的阶段已然过去，市场继续暴跌、深跌的可能性在减小，对于汇率问题，中国政府及央行将人民币知期内不存在连续贬值的基础，有足够的空间和能力稳定人民币汇率。尽管9月份A股市场继续上下波动，但两市融资规模体现市场对于股权投资，在相对有利的宏观和政策环境下，权益类指数显然会表现得稳定。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	1,161,155,438.24	88.86
	其中：股票	1,161,155,438.24	88.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	3.83
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	82,125,155.89	6.28
8	其他资产	13,476,593.15	1.03
9	合计	1,306,757,187.28	100.00

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（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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,141,516.32	0.40
C	制造业	566,166,813.09	44.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,021,177.68	0.08
E	建筑业	2,831,484.30	0.22
F	批发和零售业	21,574,280.19	1.68
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	169,291,012.49	13.22
J	金融业	98,233,258.89	7.67
K	房地产业	77,706,257.76	6.07
L	租赁和商务服务业	54,687,006.65	4.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,434,265.84	1.75
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	110,413,766.59	8.62
S	综合	7,496,004.42	0.59
	合计	1,136,996,843.92	88.79

5.2.2 报告期末（非指数投资）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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,158,594.32	1.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
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	24,158,594.32	1.89

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前十名股票投资明细

5.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	6,430,482	139,348,544.94	10.88
2	300027	华谊兄弟	3,083,881	97,543,156.03	7.62
3	000917	电广传媒	4,337,458	83,582,815.66	6.53
4	002230	达安基因	1,766,253	60,052,602.00	4.69
5	000839	中信国安	3,743,308	53,828,769.04	4.20
6	300058	蓝色光标	4,966,351	52,990,965.17	4.14
7	002353	杰瑞股份	1,542,870	34,868,862.00	2.72
8	000630	铜陵有色	14,036,480	32,424,268.80	2.53
9	000024	招商地产	1,124,090	32,025,324.10	2.50
10	000712	锦龙股份	1,780,780	28,332,209.80	2.21

5.3.2 非指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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002106	莱宝高科	1,938,892	24,158,594.32	1.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）本报告期末未持有债券资产。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）本报告期末未持有债券资产。

5.6 报告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

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内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。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	173,079.66
2	应收证券清算款	667,669,180.25
3	应收股利	-
4	应收利息	767,925.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	668,610,185.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金本报告期末未持有债券资产。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002415	海康威视	189,040,046.93	1.79	重大事项停牌
2	000858	五粮液	165,456,301.86	1.56	重大事项停牌
3	000024	招商地产	144,961,751.20	1.37	重大事项停牌

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002106	莱宝高科	31,836,606.64	0.30	重大事项停牌
2	002069	獐子岛	19,895,553.60	0.19	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

报告期（2015年8月14日-2015年9月30日）

单位：份

基金转型起始日(2015年8月14日)基金份额总额	3,645,807,269.28
报告期期初基金份额总额	3,645,807,269.28
基金转型起始日至报告期期末基金总申购份额	54,671.74
减：基金转型起始日至报告期期末基金总赎回份额	3,193,494,643.89
基金转型起始日至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	3,250,431,341.32
报告期期末基金份额总额	1,702,798,638.45

注：根据基金合同，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，2015年8月17日为国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）份额折算基准日，本基金按照1.8915652560的折算比例将基金份额进行了折算。折算日日终，本基金总份额数由3,645,807,269.28份变更为6,895,238,610.60份。

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

单位：份

报告期（2015年7月1日-2015年8月13日）

项目	国投瑞银瑞福优先封闭	国投瑞银瑞福进取封闭
本报告期期初基金份额总额	3,645,807,265.45	3,645,807,269.28
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,645,807,265.45	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	0	3,645,807,269.28

注：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》的有关规定，国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金的三年分级运作期于2015年8月13日届满，在分级运作三年期届满，无需召开基金份额持有人大会，基金日动转换为上市开放式基金（LOF）。上表的瑞福优先份额资产在分额转换基准日（2015年8月13日）终结，瑞福优先份额进行的现金结付数额。瑞福进取份额按照份额转换基准日的份额数等额转换为深证100（LOF）份额，转换后深证100（LOF）份额数为3,645,807,269.28份。

§7 基金管理人运用固有资金投资基金情况

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

报告期（2015年8月14日-2015年9月30日）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	38,099,267.00
报告期期间买入/申购总份额	33,967,526.00
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	72,066,793.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.23

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(股票投资)

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	网申发购	2015年8月19日	33,967,526.00	33,967,526.00	-
合计			33,967,526.00	-	

转型前：国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金

报告期（2015年7月1日-2015年8月13日）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	38,099,267.00
报告期期间买入/申购总份额	33,967,526.00
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	72,066,793.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.05

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	网申赎回	2015年8月13日	12,320,234.29	12,671,529.74	0
合计			12,320,234.29	12,671,529.74	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内基金管理人对本基金持有的新兴峰管（证券代码300778）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月1日。

2.报告期内基金管理人对天下本基金持有的益江股份（证券代码600539）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月3日。

3.报告期内基金管理人对天下本基金持有的东信和平（证券代码002017）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月4日。

4.报告期内基金管理人对本基金持有的欧菲光（证券代码002456）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月4日。

5.报告期内基金管理人对本基金持有的欧亚光（证券代码002061）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月4日。

6.报告期内基金管理人对本基金持有的长江电力（证券代码600900）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月4日。

7.报告期内基金管理人对公司、高管及基金经理权责重下基金相关事宜进行公告，指定媒体公告时间为2015年7月6日。

8.报告期内基金管理人对本基金持有的爱施德（证券代码002416）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月8日。

9.报告期内基金管理人对本基金持有的中国国旅（证券代码601111）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月9日。

10.报告期内基金管理人对本基金持有的中信国安（证券代码000839）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月9日。

11.报告期内基金管理人对本基金持有的兆驰股份（证券代码300408）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月9日。

12.报告期内基金管理人对本基金持有的歌尔声学（证券代码002241）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月9日。

13.报告期内基金管理人对本基金持有的广联达（证券代码300168）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月9日。

14.报告期内基金管理人对本基金持有的高盛威尼（证券代码002185）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月13日。

15.报告期内基金管理人对本基金持有的长城汽车（证券代码601633）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月13日。

16.报告期内基金管理人对本基金持有的广联达（证券代码002410）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月13日。

17.报告期内基金管理人对本基金持有的高盛威尼（证券代码002185）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月13日。

18.报告期内基金管理人对本基金持有的歌尔声学（证券代码002241）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月15日。

19.报告期内基金管理人对本基金持有的蓝盾股份（证券代码002192）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月14日。

20.报告期内基金管理人对本基金持有的歌尔声学（证券代码002241）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月16日。

21.报告期内基金管理人对本基金持有的广联达（证券代码002410）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月24日。

22.报告期内基金管理人对本基金持有的东方航空（证券代码600115）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月28日。

23.报告期内基金管理人对本基金持有的永泰能源（证券代码600157）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年7月29日。

24.报告期内基金管理人对本基金持有的苏宁云商（证券代码002024）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年8月11日。

25.报告期内基金管理人对本基金持有的蓝色光标（证券代码300058）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年8月13日。

26.报告期内基金管理人对本基金持有的苏宁云商（证券代码002024）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年8月22日。

27.报告期内基金管理人对本基金持有的五粮液（证券代码000858）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年8月25日。

28.报告期内基金管理人对本基金持有的中国中冶（证券代码601618）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年8月26日。

29.报告期内基金管理人对本基金持有的爱施德（证券代码002416）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年9月1日。

30.报告期内基金管理人对本基金持有的新希望（证券代码000876）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年9月1日。

31.报告期内基金管理人对基金行业高级管理人员变更进行公告，指定媒体公告时间为2015年8月10日。

32.报告期内基金管理人对本基金持有的新大陆（证券代码000997）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年9月26日。

33.报告期内基金管理人对本基金持有的东方财富（证券代码300059）进行估值调整，指定媒体公告时间为2015年9月26日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银瑞福和沪深300指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]1965号）

《关于国投瑞银瑞福和沪深300指数分级证券投资基金募集确认的函》（基金部函[2009]1666号）

《国投瑞银瑞福和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》

《国投瑞银瑞福和沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》

《国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露网刊上披露的信息公告原文

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）2015年第三季度报告原文

9.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址：http://www.ubsafic.com

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一五年十月二十六日

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

【2015】第三季度报告

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：2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金基金合同》的规定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银沪深300指数分级
基金主代码	161207
基金运作方式	契约型开放式。
基金合同生效日	2009年10月14日
报告期末基金份额总额	96,910,685.75份
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和建议股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。 当预期指数成份股调整和或份额将发生分红、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，以有效复制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率
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。
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
下属分级基金的基金简称	国投瑞银瑞和沪深300指数 国投瑞银瑞和小康沪深300指数 国投瑞银瑞和远见沪深300指数
下属分级基金的场内简称	瑞和300 瑞和小康 瑞和远见
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	45,261,461.75份 25,824,597.00份 25,824,597.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	265,653.66
2.本期利润	-49,728,539.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4966
4.期末基金资产净值	123,369,575.50
5.期末基金份额净值	1.2730

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

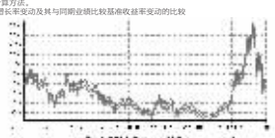
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-27.83%	3.46%	-27.05%	3.18%	-0.78%	0.28%

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90%，故以0.95×沪深300指数收益率+5%×银行同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



注：截至本报告期末各项资产配置比例分别为股票投资占基金净值比例93.58%，权证投资占基金净值比例0%，债券投资占基金净值比例0%，现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例6.92%，符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
殷瑞飞	本基金基金经理	2013年09月26日	-	8	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于汇添富基金管理有限公司，2011年4月加入国投瑞银，现任国投瑞银瑞和沪深300指数分级基金、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资源指数基金(LOF)基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定并以公告之日。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(试行)》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的说明

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》有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实保护基金份额持有人的利益的原则，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

本报告期内，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研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资执行方的监控、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在有效执行的基础上，进一步加强了对公平交易的监督力度，形成了有效的公平交易体系。

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单笔交易所涉及的证券的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年3季度，市场先后经历了二轮快速下跌的过程，引发的因素分别归结于三方面，第一轮市场下跌源于杠杆资金的不断加大所引起的A股“踩踏”事件，第二轮市场下跌源于人民币迅速贬值带来的资金流动压力，第三轮市场下跌源于海外配资清理结果，从目前市场情况来看，去杠杆最猛烈的阶段已然过去，市场继续暴跌、深跌的可能性在减小，对于汇率问题，中国政府及央行将人民币知期内不存在连续贬值的基础，有足够的空间和能力稳定人民币汇率。尽管9月份A股市场继续上下波动，但两市融资规模体现市场对于股权投资，在相对有利的宏观和政策环境下，权益类指数显然会表现得稳定。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	115,445,167.13	93.07