

(上接B073版)

公司网站: www.foundersc.com
(63) 信达证券股份有限公司
住所: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人: 张志刚
电话: 010-63081000
传真: 010-63080978
联系人: 唐静
客服电话: 400-800-8899
公司网站: www.cindasc.com
(64) 申万宏源西部证券有限公司
住所: 新疆乌鲁木齐齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址: 北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人: 许建平
电话: 010-88085201
传真: 010-88085195
联系人: 李巍
客服电话: 4008-000-562
网站: www.hysec.com
(65) 国联证券股份有限公司
住所: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9层
办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人: 姚志勇
电话: 0510-82831662
传真: 0510-82830162
联系人: 沈刚
客服电话: 96570
公司网站: www.glsc.com.cn
(66) 中国国际金融股份有限公司
住所: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人: 丁学东
电话: 010-65051166
传真: 010-65058065
联系人: 陈巍 杨祚宇 任敏
客服电话: 4009101166
公司网站: www.cicc.com.cn
(67) 华福证券有限责任公司
住所: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人: 黄金琳
电话: 0591-83893286
传真: 0591-87383610
联系人: 徐松梅
客服电话: 96326 (福建省外加拨0591)
公司网站: www.hfzq.com.cn
(68) 中航证券有限公司
住所: 南昌市红谷滩新区中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层
办公地址: 南昌市红谷滩新区中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层
法定代表人: 王宜四
电话: 0791-86768681
传真: 0791-86770178
联系人: 戴蕾
客服电话: 400-8966-567
公司网站: www.wavicsc.com.cn
(69) 中信证券股份有限公司
住所: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人: 王东明
电话: 010-60838888
传真: 010-60833739
联系人: 顾凌
客服电话: 96548
公司网站: www.cs.ecitic.com
(70) 华龙证券有限责任公司
住所: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
办公地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
法定代表人: 李晓安
电话: 0931-4890208
传真: 0931-48906280
联系人: 李昕田
客服电话: 96368
公司网站: www.hlzq.com
(71) 华融证券股份有限公司
住所: 北京市西城区金融大街8号
办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人寿保险大厦12层
法定代表人: 阮晓志
电话: 010-85956100
传真: 010-85566153
联系人: 李慧灵
客服电话: 400-898-9999
公司网站: www.hrsec.com.cn
(72) 世纪证券有限责任公司
住所: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
办公地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
法定代表人: 姜昧军
电话: 0755-83199611
传真: 0755-83199645
联系人: 袁媛
客服电话: 0755-83199511
公司网站: www.cscc.com.cn
(73) 中原证券股份有限公司
住所: 郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人: 菅明军
电话: 0371-69098882
传真: 0371-65586899
联系人: 程月艳 范春梅
客服电话: 0371-967218, 400-813-9666
公司网站: www.ccnew.com
(74) 长城国瑞证券有限公司
住所: 厦门市厦门西路2号连富大厦十七楼
办公地址: 厦门市厦门西路2号连富大厦十七楼
法定代表人: 王勇
电话: 0592-5161642
传真: 0592-5161140
联系人: 赵歆
客服电话: 0592-5163558
公司网站: www.xmzq.com
(75) 爱建证券有限责任公司
住所: 上海市浦东世纪大道1600 号陆家嘴商务广场32楼
办公地址: 上海市浦东世纪大道1600 号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人: 钱华
电话: 021-32229888
传真: 021-68728707
联系人: 王薇
客服电话: 4001-962502
公司网站: www.wajz.com
(76) 财达证券有限责任公司
住所: 河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址: 河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
法定代表人: 翟建强
电话: 0311-66006342
传真: 0311-66006201
联系人: 马辉
客服电话: 4006128888
公司网站: www.citicafund.com
(77) 东北证券股份有限公司
住所: 长春市自由大路1138号
办公地址: 长春市自由大路1138号
法定代表人: 杨树财
电话: 0431-85090617
传真: 0431-85096795
联系人: 安岩岩
客服电话: 400-600-0686
公司网站: www.nesc.cn
(78) 日信证券有限责任公司
住所: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号长安兴融大厦11层
法定代表人: 孔佑杰
电话: 010-83991716
传真: 010-88086637
联系人: 陈文彬
客服电话: 400-660-9839
公司网站: www.rxzq.com.cn
(79) 民生证券有限责任公司
住所: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人: 余政
电话: 010-85127999
传真: 010-85127917
联系人: 赵明
客户服务电话: 400-619-8888
网站: www.msizq.com
(80) 东吴证券股份有限公司
住所: 苏州工业园区星阳街5号
办公地址: 苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
法定代表人: 范力
电话: 0512-65681136
传真: 0512-65688021
联系人: 方晓丹
客户服务电话: 4008-601-555
网站: www.dwzq.com.cn

(81) 国海证券股份有限公司
注册地址: 广西桂林市辅星路13 号
办公地址: 深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦11楼
法定代表人: 何春梅
电话: 0755-82047857
传真: 0755-82835785
联系人: 陈秋华
客户服务电话: 95563
网站: www.guozh.com.cn
(82) 联讯证券股份有限公司
住所: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人: 徐刚
电话: 0752-2119700
传真: 0752-2119306
联系人: 彭莲
客户服务电话: 95564
公司网站: www.lxqz.com.cn
(83) 华鑫证券有限责任公司
住所: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1) 单元
办公地址: 上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人: 俞萍
电话: 021-64339000
传真: 021-54967293
联系人: 杨利娟
客服电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918
公司网站: www.cfsc.com.cn
(84) 浙商证券股份有限公司
住所: 杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
办公地址: 杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
法定代表人: 丁学东
电话: 021-64310572
传真: 021-64713795
联系人: 陆云
客服电话: 0571-967777
公司网站: www.stocke.com.cn
(85) 天相投资顾问有限公司
注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座505
法定代表人: 林义相
联系电话: 010-66045152
传真: 010-66045518
联系人: 尹伶
客服电话: 010-66045678
天相投顾网站: http://www.txsec.com
天相基金网站: www.jfj.com.cn
(86) 深圳众禄基金销售有限公司
住所: 深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址: 深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人: 薛峰
电话: 0755-33227950
传真: 0755-33227951
联系人: 童彩平
客户服务电话: 4006-788-887
网站: www.zlfund.cn及www.jfmm.com
(87) 上海好买基金销售有限公司
住所: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市虹口区欧阳路196号(兰芬创意园) 26号楼2楼、上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人: 杨文斌
电话: 021-20613999
传真: 021-68598916
联系人: 张茹
客户服务电话: 400-700-9665
网站: www.ehowbuy.com
(88) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人: 张庆伟
电话: 021-20691832
传真: 021-20691861
联系人: 单丙炜
客户服务电话: 400-820-2899
网站: www.erichfund.com
(89) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所: 上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址: 上海市杨浦区昆明路 508号北美广场B座12楼
法定代表人: 汪静波
电话: 021-38602377
传真: 021-38509777
联系人: 王捷辉
客户服务电话: 400-821-5399
网站: www.noah-fund.com
(90) 杭州数米基金销售有限公司
住所: 杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道3688号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
电话: 021-60897840
传真: 0571-26697013
联系人: 李晓明
客服电话: 4000-766-123
公司网站: market.fund123.cn
(91) 上海天天基金销售有限公司
住所: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
办公地址: 上海市天田路195号3C座7楼
法定代表人: 其实
电话: 021-54560988
传真: 021-64638508
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn
(92) 北京展恒基金销售有限公司
住所: 北京市顺义区后沙峪镇富富街9号
办公地址: 北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦二层
法定代表人: 闫振杰
电话: 010-60200356
传真: 010-60200358
联系人: 王琳
客服电话: 400-818-8000
公司网站: www.myfund.com
(93) 浙江同花顺基金销售有限公司
住所: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址: 浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人: 凌顺平
电话: 0571-88911818-8853
传真: 0571-86890423
联系人: 王桂林
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(94) 和讯信息科技有限公司
住所: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人: 王利
电话: 021-20835779
传真: 021-20835879
联系人: 吴卫
客服电话: 400-920-0022
公司网站: iicaike.hexun.com
(95) 信普泽投资顾问(北京)有限公司
住所: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809室
法定代表人: 沈伟伟
电话: 010-52856713
传真: 010-58594285
联系人: 王巨明
客服电话: 400-6099-200
公司网站: www.yixinfund.com
(96) 上海大智慧财富管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址: 上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人: 申健
电话: 021-20219923
传真: 021-20219923
联系人: 付江
客服电话: 021-20219931
公司网站: g.gw.com.cn
(97) 中信建投期货有限公司
住所: 重庆渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B, 名义层11-A, 8-B, 9-B, C
办公地址: 重庆渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人: 彭文德
电话: 023-86769637
传真: 023-86769629
联系人: 刘芸
客服电话: 400-8877-780
公司网站: www.cfc108.com
(98) 中信期货有限公司
住所: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期) 北座13层1301-1305室、14层
办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期) 北座13层1301-1305室、14层
法定代表人: 张皓
电话: 0755-23963913
传真: 0755-83217421
联系人: 洪诚
客户服务电话: 400-990-8826

网址: www.ctiact.com
(99) 上海陆金所资产管理有限公司
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人: 郭坚
联系人: 宁博宇
电话: 021-20666952
传真: 021-22066653
客户服务电话: 4008219031
网站: www.lufunds.com
(100) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址: 上海市黄浦区100号19层
办公地址: 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人: 冯晓敏
电话: 7021-33323999
传真: 021-33323830
联系人: 周丹
客服电话: 400-820-2819
网站: fund.bundtrade.com
(101) 上海联泰资产管理有限公
司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址: 上海市福泉北路518号8层3
法定代表人: 燕斌
电话: 021-52222063
传真: 021-52975270
联系人: 凌秋艳
客服电话: 400-046-6788
网站: www.68zichan.com
(102) 珠海盈米财富管理有限公司
住所: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
法定代表人: 肖雯
联系人: 吴煜浩
电话: 020-89629021
传真: 020-89629011
客服电话: 020-89629066
网站: www.yingm.com.cn
3、基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。
(二) 注册登记机构
名称: 国投瑞银基金管理有限公司
住所: 上海市虹口区东大名路638号7层
办公地址: 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人: 叶柏寿
电话: (0755) 83575836
传真: (0755) 82912534
联系人: 冯伟
客服电话: 400-880-6868
(三) 律师事务所
名称: 北京市金杜律师事务所
住所: 北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
办公地址: 北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
负责人: 王玲
经办律师: 靳庆军、宋萍萍
电话: (010) 58785688
传真: (010) 58785699
联系人: 宋萍萍
(四) 会计师事务所和经注册会计师
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
执行事务合伙人: Ng Albert Kong Ping 吴慧平
电话: (010) 58153000、(0755) 25022828
传真: (010) 85188298、(0755) 25026188
签字注册会计师: 吕华、高鹤
联系人: 吕华
四、基金的名称
本基金名称: 国投瑞银创新动力混合型证券投资基金。
五、基金的类型
本基金类型: 混合型。
基金运作方式: 契约型开放式。
六、基金的投资目标
本基金的投资目标是: 通过投资主要以创新为原动力的优质上市公司股票, 分享企业成长带来的超额回报, 实现基金资产的长期稳定增值。
七、基金的投资方向
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、债券及法律、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: 股票组合投资占基金资产的60%-95%; 除股票资产以外的其他资产投资占基金资产的5%-40%; 其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。在股票投资方面, 本基金将采取精选创新能力显著的优质企业股票的投资策略。80%以上的非现金基金资产将投资于创新能力显著的企业股票。创新能力显著的优质企业的特点是: 以创新作为企业成长的原动力, 通过自主研发和消化吸收, 在经营过程中逐渐形成不容易被竞争对手仿效的核心竞争力, 在市场中取得竞争优势, 为公司创造高于竞争对手的市场份额或高于行业平均水平的利润率, 从而提升公司价值。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人将在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。
八、基金的投资策略
本基金将借鉴瑞银全球资产管理公司投资管理经验, 根据中国市场的特, 采取积极的投资管理策略。
1、战略资产配置
本基金以“自下而上”的股票精选为主。通过适度调整类别资产具体配置比例, 减少基金的系统性风险。调整股票资产和债券资产的具体配置比例时所考虑的因素主要有: 整体市场估值水平、市场预期、宏观经济运行状况、利率水平、货币供应量、制度因素等。在整体市场估值水平方面, 本基金主要关注市场整体估值水平的高低以及市场整体盈利增长速度的高低; 在市场预期方面, 本基金将主要考虑预期股票市场上或者向下的驱动因素以及各市场主体之间市场预期之间的差距; 在宏观预期方面, 本基金主要关注GDP、工业增加值以及社会商品零售总额的增长速度; 在利率水平方面, 主要关注由于市场收益率水平变化引起的资本成本的变化; 在政策方面主要关注政府货币政策、财政政策以及其他产业政策等的变动。
除以上考虑因素外, 在类别资产上的主动性配置时他们也会利用基金管理人长期投资管理过程中所积累的经验, 以应对突发事件、财报季节性效应以及市场非有效对外效应所形成的短期市场波动。
2、股票投资管理
本基金的股票投资决策, 以自下而上的公司基本面分析为主。构建股票组合的步骤是: 确定股票初选库; 基于公司基本全面考量、企业创新性评价与GEVS等估值方法, 分析股票内在价值、风险管理; 构建股票组合并对其进行动态调整。
(1) 全面考量公司基本面。本基金评估公司基本面的主要指标包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。
分析师从定性和定量两个方面考察行业竞争趋势、公司的竞争地位、短期和长期内公司现金流增长的主要驱动因素、业务发展的关键点以及公司治理结构状况。分析师要说明做出财务预测(包括GEVS模型输入变量)的重要假设条件, 并评估其合理性的可信性, 对公司事件做出明确的定性判断和定量研究, 给出明确的公司评价和投资建议。
(2) 企业的创新性评价。本基金通过研究企业的R&D投入和创新行为, 来衡量企业是否具有创新型企业属性。创新行为包括技术创新、产品或服务创新、商业模式创新、需求创新、流程创新和管理创新, 等等。其中, 分析师要着重考量创新行为为预期效果, 创新是否成为企业成长的驱动力。在分析行为为的预期效果时, 需结合企业创新管理能力的考量, 针对具体的创新项目, 分析师将努力通过分析项目的预期投资回报率对创新效果进行评价; 预期投资回报率衡量指标包括销售收入边际增长率、毛利率边际增长率、投入资本回报率等。
(3) 本基金借鉴GEVS, 以合适方法估计股票投资价值。GEVS是UBS AM 在全球使用了20多年的权益估值模型。模型分阶段考量现金流量增长率, 将各阶段现金流量现值总和, 即股票的内在于价值。市场价格与内在价值的差额是基金买入或卖出的主要参考依据。借鉴GEVS方法, 需要参考中国股票市场特点和某些行业或公司的具体情况。在实践中, 现金流量贴现模型可能有些假设不理想的情形。根据实际情况, 我们不排除选用其它合适的估值方法, 如P/B、P/E、EV/EBITDA等方法。
(4) 构建(及调整) 模拟组合。股票策略组借鉴UBS AM 全球股票研究经验, 评估股票投资价值, 考量分析师最有价值的研究成果, 在充分评估估值的基础上, 构建(及调整) 股票模拟组合。
(5) 风险管理及归因分析。在形成可执行组合之前, 模拟组合需经风险考量和风险调整。国投瑞银借组GERS等风险管理系统技术, 对模拟组合(事前) 和实际投资组合(事后) 进行风险评估、绩效与归因分析, 从而确定可执行组合以及组合调整策略。
3、债券投资管理
本基金借鉴UBS AM 固定收益组合的管理方法, 采取“自上而下”的债券分析方法, 确定债券模拟组合, 并管理组合风险。
(1) 评估债券价值。债券基本价值评估的主要依据是均衡收益率曲线(Equilibrium Yield Curves)。
均衡收益率曲线是所有相关的风险都得到补偿时, 收益率曲线的合理位置。风险补偿包括四个方面: 资金的时间价值(补偿)、通货膨胀补偿、期限补偿、流动性及信用风险补偿。
本基金基于均衡收益率曲线, 计算不同资产类别, 不同剩余期限配置的预期超额回报, 根据预期超额回报进行排序, 得到投资评级。
(2) 选择投资策略。债券投资策略主要包括: 久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同时期, 以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同, 具体采用何种策略, 取决于债券组合允许的风险程度。
(3) 构建(及调整) 债券组合。债券策略组将借鉴UBS AM 价值研究方法, 凭借各成员债券投资管理经验, 评估债券组合与内在价值偏离幅度是否可容, 据此构建债券模拟组合。
(4) 风险管理及归因分析。国投瑞银借组UBS AM 全球固定收益证券风险管理系统(GFRS) 方法管理债券组合风险。GFRS方法关注组合风险管理, 包括久期、剩余期限、汇率和信用特征。把组合总体风险分解为市场风险、发行人特定风险和汇率风险等。
4、权益投资策略
(1) 考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、

行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素, 估计权证合理价值。
(2) 根据权证合理价值与其市场价格的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性, 结合标的股票合理价值考量, 决策买入、持有或沽出权证。
九、基金的业绩比较标准
业绩比较标准=沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
本基金属于混合型基金, 一般情况下, 股票投资的比例大约为基金资产的80%。基于本基金的资产配置比例范围, 我们选用市场代表性较好的沪深300指数和中债综合指数加权重作为本基金的投资业绩评价基准。
如果今后法律法规发生变化, 或者市场中出现更具有代表性的业绩比较基准, 本基金将根据实际情况对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更需经报中国证监会备案且及时公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金, 属于预期风险收益较高的基金品种, 其预期风险和预期收益高于债券型基金, 低于股票型基金。
十一、基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日, 本报告中所列财务数据未经审计。
1、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	933,428,357.96	82.81
2	其中: 股票	933,428,357.96	82.81
3	固定收益投资	90,881,992.50	8.06
4	其中: 债券	90,881,992.50	8.06
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	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	91,349,044.07	8.10
11	其他资产	11,548,618.39	1.02
12	合计	1,127,208,012.92	100.00

2、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	-	-
C	制造业	714,873,188.10	63.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,345,021.60	2.98
E	建筑业	46,332,442.75	4.14
F	批发和零售业	47,617,351.60	4.26
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	69,625,949.91	6.23
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	21,634,389.00	1.93
O	国民经济、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		933,428,357.96	83.45

3、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	占基金资产净值比例(%)
1	000028	国药一致	843,980	47,617,351.60	4.26
2	600612	老凤祥	930,667	43,108,495.44	3.85
3	300273	佳佳股份	2,124,570	40,982,956.30	3.66
4	000999	华润三九	1,758,457	40,972,048.10	3.66
5	600271	航发信息	750,330	40,285,217.70	3.60
6	600406	国电南瑞	2,560,306	36,330,742.14	3.25
7	000958	东方能源	1,263,069	32,652,021.60	2.98
8	002510	天气新	3,167,115	32,652,021.60	2.92
9	600469	风神股份	2,511,401	32,397,072.20	2.90
10	600781	东方金钰	1,619,128	31,346,318.08	2.80

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,298,000.00	6.29
4	其中: 政策性金融债	70,298,000.00	6.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	20,583,992.50	1.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,881,992.50	8.13

5、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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150206	15国开06	400,000	40,268,000.00	3.60
2	110212	11国开12	300,000	30,030,000.00	2.68
3	113008	电气转债	156,950	20,583,992.50	1.84

注: 本基金本报告期末仅持有以上债券。
6、按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、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。
8、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
根据本基金合同规定, 本基金不参与股指期货交易。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
根据本基金合同规定, 本基金不参与国债期货交易。
11、投资组合报告附注
(1) 本基金投资的前十名证券中, 持有“风神股份”市值32,397,072.9元, 占基金资产净值2.9%; 根据风神轮胎股份有限公司2015年3月9日公告, 该公司由于信息披露违法违规, 2015年3月6日公司收到中国证监会行政处罚决定书(津证罚字〔2015〕1号), 该处罚决定书对2015年3月6日公司发布的《行政处罚决定书》, 该处罚决定书以警告并处以60万元罚款, 曹朝阳等直接责任人员分别被予以警告和处以罚款。基金管理人认为, 该公司上述调查和处罚事项有利于公司加强内部管理, 公司当前总体生产经营和财务状况保持稳健, 事件对该公司经营未产生实质性影响, 不改变该公司基本面。
本基金对上述证券的投资严格执行了基金管理人规定的投资决策程序。
除上述情况外, 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。
(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。
(3) 其他资产的构成
金额单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,332,711.60
2	应收证券清算款	7,209,762.30
3	应收股利	-
4	应收利息	922,388.31
5	应收申购款	83,756.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,548,618.39

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	20,583,992.50	1.84

(5) 报告期末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	占基金资产净值比例(%)	受限原因
1	600781	辅仁药业	31,346,318.08	2.80	重大资产重组

(6) 其他需说明的重要事项
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。

十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
国投瑞银创新基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止2015年9月30日)

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
2006.11.15(基金合同生效日)至2006.12.31	30.14%	1.51%	25.12%	1.22%	5.02%	0.29%
2007.01.01至2007.12.31	129.88%	2.06%	117.59%	1.84%	12.29%	0.22%
2008.01.01至2008.12.31	-51.72%	2.19%	-64.88%	2.40%	3.16%	-0.21%
2009.01.01至2009.12.31	80.52%	1.92%	72.12%	1.63		