

**[2015] 第一季度度报告**

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

序号	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	23,673,897.43	33.54
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	3,770,185.00	8.53
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	2,905,894.52	6.57
J	金融业	3,762,462.00	8.51
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	621,346.00	1.41
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	卫生和社工作	--	--
Q	文化、体育和娱乐业	--	--
S	合计	34,733,784.95	78.56

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占金融资产净值比例(%)
1	002247	壹壹新材	145,000	247,140.00	5.47
2	300032	金力泰	46,110	2,380,441.00	5.47
3	002659	汇川股份	118,000	2,296,840.00	5.47
4	601318	中国平安	28,000	2,091,720.00	4.91
5	300234	华信新材	199,200	2,169,804.00	4.91
6	002251	步步高	77,300	2,094,830.00	4.74
7	002050	三花股份	106,709	2,065,933.37	4.63
8	601058	赛轮金宇	100,000	2,005,000.00	4.57
9	600499	信达地产	80,000	1,813,600.00	4.16
10	002644	佛慈制药	59,910	1,720,016.10	3.80

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
	其中:政策性金融债	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债	527,116.80	1.15
8	其他	--	--
	合计	527,116.80	1.15

[illegible]

11.1 被投资报告期末，本基金持有的有价证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日未受到公开谴责、处罚。

11.1.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定选股策略内的股票。

11.1.3 基金资产构成

序号	名称	金额	单位：人民币元
1	存出保证金	35,606.73	
2	应收证券清算款	602,324.58	
3	应收股利	-	
4	应收利息	2,550.32	
5	应收申购款	182,610.47	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	

8	其他			-	
9	合计				821,186.10
<b>§1.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细</b>					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	110023	民生转债	527,116.80	1.19	
<b>§1.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明</b>					
序号	股票代码	股票名称	流通受限股份的数量 或公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限原因
1	603509	罗欣制药	1,008,177.00	5.17	重大资产重组
<b>§1.1.6 投资组合报告期内发生的其他文据披露事项</b>					
本基金本期未投资过银行理财产品、未投资过证券公司主承销的证券、未从二级市场主动投资分离交易可转债的投资、证券投资受限证券均未违反相关法律法规或本基金管理公司规定的。					
<b>§6 开放式基金份额变动</b>					
单位：份					
报告期期初基金份额总额					37,223,266.78
报告期期间基金总申购份额					14,698,697.78
减：报告期期间基金总赎回份额					(21,847,015.97)
报告期期间基金净申购份额(亏损减少以“-”填列)					-
报告期期末基金份额总额					30,074,953.59
<b>§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况</b>					
本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。 <b>§8 影响投资者决策的其他重要信息</b>					
本报告期内基金管理人于旗下公募基金调整交易所指定估值品种和估值方法进行公告，指定媒体公布。发布日期为： 1、2015年3月31日； 2、2015年4月17日。					
本报告期基金管理人对本基金经理变更进行公告，指定媒体公布时间为2015年3月14日；					
本报告期内基金管理人对本基金持有的港股股份（证券代码600348）、大北农（证券代码002239）投资（证券代码0000858）进行估值调整，指定媒体公布时间为2015年3月5日。					

3. 关于报告期内基金管理人运用基金资产进行的高薪支付（证券代码300088）和二倍薪酬（证券代码002002）的核查情况，指定媒体公开时间为2016年3月31日

§9 备查文件目录

3.1 备查文件目录

关于《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2011]665号）

关于《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金投资基准基金备案确认的》（基金部函[2011]665号）

《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金投资基准基金（LOF）基金合同》

《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金（LOF）基金托管协议》

《国投瑞银基金管理有限公司营业规则》、《公司章程》及《基金管理人业务资格批件和证券基金业务牌照》

中国证监会于报告期内中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

《国投瑞银新兴产业混合型证券投资基金（LOF）2016年第一次年度报告全文

2. 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4020号荣超经贸中心46层

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：400-880-6888

国投瑞银基金管理有限公司  
二〇一五年四月

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	120,000,000.00	4.80
	其中：政策性金融债	120,000,000.00	4.80
4	企业债券	8,990,100.00	0.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,917,360.80	0.24
8	其他	-	-

	十	134,913,460.80	5.40		
<b>(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债券投资明细</b>					
			<b>金额单位：</b>		
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	140213	14国开13	1,000,000	100,890,000.00	0.80
2	140207	14国开07	200,000	20,096,000.00	0.00
3	121165	12国债08	90,000	8,990,100.00	0.00
4	113008	集气转债	42,620	5,937,360.80	0.24
<b>(10) 报告期末公司持有的基金资产净值比例大小排名前五只货币证券投资组合明</b>					
本基金本报告期未持有货币证券。					
<b>(11) 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</b>					
本基金本报告期未持有贵金属。					
<b>(12) 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</b>					
本基金本报告期未持有权证。					
<b>(13) 报告期末按成本价计算的股指期货交易情况说明</b>					
报告期内，本基金不存在持仓的股指期货合约。					
<b>(14) 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股票投资明细</b>					
本基金本报告期未持有股票。					
<b>(15) 报告期末前十名证券投资主体本期有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况</b>					
无。本基金的前十名股权投资对象在本报告期没有发生行政处罚或刑事处罚的情形。					
				<b>单位：元</b>	
序号	股票代码	名称	金额		
1		存出保证金	154,194.81		
2		应收证券清算款			
3		应收账款			
4		应收利息			
5		应收申购款	5,301,283.42		
6		其他应收款			
7		待摊费用			
8		预收账款			
9		合计	5,455,478.23		
<b>(16) 报告期末前十大权益类资产的转股损益明细</b>					
本基金本报告期未持有“可转债”、“可交换债”等品种。					
<b>(17) 报告期末前十大基金份额持有人存在违规减持情况的说明</b>					
无。					
<b>金额单位：元</b>					

[illegible]

---