（上接B067版）

联系人：周俊
客服电话：400-666-2288
公司网站：www.jhzq.com.cn
（54）华宝证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人：陈林
电话：021-68778790
传真：021-68777992
联系人：刘闻川
客服电话：400-820-9898
公司网站：www.cnhbstock.com
（55）财富证券有限责任公司
住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人：孙智勇
电话：0731-84403319
传真：0731-84403439
联系人：郭磊
客服电话：0731-84403350
公司网站：www.cfzq.com
（56）方正证券股份有限公司
住所：北京市西城区阜外大街甲34号方正证券大厦5楼
办公地址：北京市西城区阜外大街甲34号方正证券大厦5楼
法定代表人：雷杰
电话：010-68546765
传真：010-68546792
联系人：徐锦福
客服电话：95571
公司网站：www.foundersc.com
（57）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
（58）申万宏源西部证券有限公司@住所：新疆乌鲁木齐市高新区（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@网址：www.hysec.com
（59）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：95570
公司网站：www.glsc.com.cn
（60）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：陈曦、杨涵宇、任敏
客服电话：4009101166
公司网站：www.cicc.com.cn
（61）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
（62）中航证券有限公司
住所：南昌市红谷滩中心区红谷中大道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：400-8866-567
公司网站：www.avicsec.com
（63）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：95548
公司网站：www.cs.ecitic.com
（64）华龙证券股份有限公司
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：931-48906280
联系人：邓鹏怡
客服电话：95368
公司网站：www.hlzq.com
（65）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号中国人保寿险大厦12层
法定代表人：祝献忠
电话：010-85556100
传真：010- 85556153
联系人：李慧灵
客服电话：400-898-9999
公司网站：www.hrsec.com.cn
（66）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：0755-83199511
传真：0755-83199545
联系人：袁媛
客服电话：0755-83199511
公司网站：www.csco.com.cn
（67）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：管明军
电话：0371--69099882
传真：0371--65585899
联系人：程月艳 范春艳
客服电话：95377
公司网站：www.ccnew.com
（68）长城国瑞证券有限公司
住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：王勇
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
联系人：赵钦
客服电话：0592-5163588
公司网站：www.xmzq.cn
（69）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.ajzq.com
（70）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
公司网址：www.S10000.com
（71）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：0431-85096517
传真：0431-85096795
联系人：安岩岩
客服电话：400-600-0686
公司网站：www.nesc.cn
（72）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
（73）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
网址：www.mszq.com
（74）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：0512-65581136
传真：0512-65588021
联系人：方晓丹
客户服务电话：4008-601-555
网址：www.dwzq.com.cn
（75）长江证券股份有限公司@注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦@办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦@法定代表人：杨泽柱 @客户服务热线：95579或4008-888-999@联系人：奚博宇@电话：027-65799999@传真：027-85481900@长江证券客户服务网站：www.95579.com
（76）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：陈炽华
客户服务电话：95563
网址：www.ghzq.com.cn
（77）联讯证券有限责任公司
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：0752-2119396
联系人：彭莲
客户服务电话：95564
公司网址：www.lxzq.com.cn
（78）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（b）单元
办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人：俞洋
电话：021-64339000
传真：021-54967293
联系人：杨莉娟
客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
公司网址：www.cfsc.com.cn
(79) 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：吴承根
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
（80）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
天相投顾网址：http://www.txsec.com
天相基金网网址：www.jjm.com.cn
（81）深圳众禄金融控股股份有限公司
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
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
（82）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：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室，上海市虹口区欧阳路196号（法兰桥创意园）26号楼2楼
法定代表人：杨文斌
电话：021-20613999
传真：021-68596916
联系人：张茹
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com
（83）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：单丙烨
电话：021-20691832
传真：021-20691861
客服电话：400-820-2899
公司网站：www.erichfund.com
（84）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：王建辉
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
（85）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：浙江省杭州省滨江区江南大道3588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：朱晓超
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn
（86）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
办公地址：上海市龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509998
传真：021-64385308
客服电话：400-1818-188
公司网站：www.1234567.com.cn
（87）北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6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：010-59601366
传真：010-62020355
联系人：王琳
客服电话：400-818-8000
公司网站：www.myfund.com
（88）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：王莉
电话：021--20835779
传真：021-20835879
联系人：吴卫东
客服电话：400-920-0022
公司网站：licaike.hexun.com
（89）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：0571-88911818-8653
传真：0571-86800423
联系人：汪林林
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.5ifund.com
（90）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-B4，9-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
（91）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：0755-23953913@传真：0755-83217421
联系人：洪诚@客户服务电话：400-990-8826@网址：www.citicsf.com
（92）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：冯修敏
电话：021-33323999
传真：021-33323830
联系人：周丹
客服电话：400-820-2819
网站：fund.bundtrade.com
（93）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座3层@法定代表人：燕斌@电话：021-52822063@传真：021-52975270@联系人：凌秋艳@客服电话：400-046-6788@网站：www.66zichan.com
（94）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.yingmi.cn
（95）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：021-20219988
传真：021-20219923
联系人：付江
客服电话：021-20219931
公司网站：8.gw.com.cn
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为本基金的代销机构，并及时公告。

（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：（010）59378856
传真：（010）59378907
联系人：崔巍
（三）为本基金转型出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
经办律师：安冬、孙睿
联系人：安冬
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
签章注册会计师：薛竞、叶尔甸
联系人：刘莉
四、基金的历史沿革和存续
（一）基金历史沿革
本基金由国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）通过基金合同修订变更而来。
国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金 （LOF） 经中国证监会2010年1月15日证监许可【2010】69号文核准募集，基金合同于2010年4月9日正式生效，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。国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会自2013年9月9日起至2013年10月18日17:00止以通讯方式召开，会议审议通过了《关于国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）变更为国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》，经中国证监会备案，基金份额持有人大会决议生效。依据基金份额持有人大会决议，《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自2013年11月5日生效，基金投资目标、范围和策略调整，同时“国投瑞银沪深300金融地产指数证券投资基金（LOF）”更名为“国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。
（二）基金场内份额的转换
《基金合同》生效后，本基金场 内份额将转换为国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金份额。
1、基金份额转换的对象
本基金《基金合同》生效日登记在册的所有场内份额。
2、基金份额转换的原则
转换完成后，除由于取整造成的误差外，场内份额持有人的资产总值保持不变。
对份额转换公式说明如下：
若T日为场内份额转换基准日，则场内份额转换的公式为：
?场内份额转换比例=联接基金T日份额净值 / 金融地产ETF基金T日份额净值
转换后场内份额持有人持有的金融地产ETF份额 = 转换前场内份额持有人持有的联接基金份额 × 场内份额转换比例
其中，场内份额转换比例采用四舍五入的方式保留到小数点后9位，转换后的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。具体份额以基金注册登记机构的记录为准。
3、基金份额转换的时间
本基金《基金合同》生效后的5个工作日内。
关于本基金场内份额转换的具体安排，请参见相关公告。
（三）基金合同生效后的基金份额持有人数量和资产规模限制
《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。
法律法规另有规定时，从其规定。
五、基金的名称
本基金名称：国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金
六、基金的类型契约型开放式
七、基金的投资目标
本基金通过主要投资于目标ETF基金份额，力争实现对业绩比较基准的紧密跟踪。
八、基金的投资方向
本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标， 本基金也可少量投资于非成份股 （包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离交易可转债存债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债等）、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。
本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
九、基金的投资策略
（一）资产配置策略
本基金为目标ETF的联接基金，投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。
（二）目标ETF投资策略
本基金可以通过一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的投资，本基金将根据开放日申购赎回情况，综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标ETF的投资方式。此外，本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。
（三）股指期货投资策略
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，以提高投资组合的运作效率。
本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。
十、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准：95%×沪深300金融地产指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
如果目标ETF变更业绩比较基准、或沪深300金融地产指数编制单位变更或停止沪深300金融地产指数的编制及发布、或沪深300金融地产指数由其他指数替代、或沪深300金融地产指数编制方法发生重大变更导致该指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，调整业绩比较基准并及时公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人在取得基金托管人同意后报中国证监会备案并及时公告。
十一、基金的风险收益特征
本基金为ETF联接基金，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市场基金、债券型基金和混合型基金。
十二、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	14,706,489.63	3.05
	其中：股票	14,706,489.63	3.05
2	基金投资	435,169,912.25	90.14
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	-	-
	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	32,046,884.71	6.64
8	其他资产	832,531.36	0.17
9	合计	482,755,817.95	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	-	-
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	12,747,774.78	2.65
K	房地产业	1,958,714.85	0.41
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	14,706,489.63	3.06

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	000712	锦龙股份	96,600	1,536,906.00	0.32
2	601318	中国平安	41,466	1,238,174.76	0.26
3	600036	招商银行	63,000	1,119,510.00	0.23
4	600016	民生银行	113,400	958,230.00	0.20
5	600000	浦发银行	43,200	718,416.00	0.15
6	000024	招商地产	23,565	671,366.85	0.14
7	601166	兴业银行	43,000	626,080.00	0.13
8	601818	光大银行	137,600	533,888.00	0.11
9	000002	万科A	37,800	481,194.00	0.10
10	601328	交通银行	75,600	459,648.00	0.10

4、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。
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
本基金本报告期末未持有债券资产。
6、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资产。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。
（2）本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。
本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。
基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。
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	704,257.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,220.27
5	应收申购款	122,053.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	832,531.36

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有债券资产。
（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（%）	流通受限情况说明
1	000712	锦龙股份	1,536,906.00	0.32	重大事项停牌

（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。
十三、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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
基金净值表现详见下表：
国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接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
2010. 04. 09（原基金合同生效日）至2010.12.31	-17.80%	1.71%	-19.74%	1.71%	1.94%	-
2011.01.01至2011.12.31	-13.75%	1.30%	-14.44%	1.32%	0.69%	-0.02%
2012.01.01至2012.12.31	22.43%	1.23%	20.79%	1.23%	1.64%	0.00%
2013.01.01至2013.12.31	-8.32%	1.73%	-9.08%	1.74%	0.76%	-0.01%
2014.01.01至2014.12.31	82.70%	1.59%	80.96%	1.60%	1.74%	-0.01%
2015.01.01至2015.06.30	3.37%	2.46%	3.13%	2.44%	0.24%	0.02%
2015.07.01至2015.09.30	-24.55%	3.01%	-25.27%	3.05%	0.72%	-0.04%
自2010年4月9日（原基金基金合同生效日）起至今	13.40%	1.72%	5.15%	1.73%	8.25%	-0.01%

注：1、本基金是以国投瑞银沪深300金融地产交易型指数基金为目标的联接基金，对目标ETF 的配置不低于基金资产净值90%，故以95%×沪深300金融地产指数收益率+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。
十四、费用概览
（一） 与基金运作有关的费用
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H = E × 0.6% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则E取0）。
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.13%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H = E × 0.13% ÷ 当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分所对应的基金资产后的余额（若为负数，则E取0）。
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
3、上述一、基金费用的种类中第3－7项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（三）不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（四）与基金销售有关的费用
1、申购费率
（1）本基金的前端申购费率如下表：

申购金额（M）	申购费率
M＜100万元	1.2%
100万元≤M＜500万元	0.8%
500万元≤M＜1,000万元	0.4%
M≥1,000万元	每笔1,000元

（2）本基金的后端申购费率如下表：

持有时间（Y）	后端申购费率
Y＜1年	1.4%
1年≤Y＜2年	1.2%
2年≤Y＜3年	0.8%
3年≤Y＜4年	0.4%
Y≥4年	0

（3）本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
2、赎回费率
（1）本基金的赎回费率如下表：

持有时间（T）	赎回费率
T＜1年	0.5%
1≤T＜2年	0.25%
T≥2年	0%

注：上表中，1年按365天计算。
（2）赎回费用由基金赎回人承担。
（3）投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%。
3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。
4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。
（五）与基金销售有关的费用的计算
1、基金申购采用金额申购的方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。投资者可以选择支付前端申购费用或者后端申购费用。
（1）若投资者选择支付前端申购费用，则申购份额的计算公式为：
净申购金额 = 申购金额/（1+前端申购费率）；
前端申购费用 = 申购金额-净申购金额；
申购份额 = 净申购金额/申购当日基金份额净值。
（2）若投资人选择支付后端申购费用，则申购份额的计算公式为：
申购份额 = 申购金额/申购当日基金份额净值；
当投资人提出赎回时，后端申购费用的计算方式为：
后端申购费用 = 赎回份额 × 申购当日基金份额净值 × 后端申购费率
2、本基金赎回金额的计算
（1）若投资者申购时选择支付前端申购费用，则赎回时净赎回金额的计算公式为：
赎回总金额=赎回份额(T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额(赎回费率
净赎回金额=赎回总金额(赎回费用
（2）若投资者申购时选择支付后端申购费用，则赎回时净赎回金额的计算公式为：
赎回总金额 = 赎回份额 × T日基金份额净值
后端申购费用 = 赎回份额 × 申购当日份额净值 × 后端申购费率
赎回费用=赎回总金额(赎回费率
净赎回金额=赎回总金额 - 后端申购费用 - 赎回费用
（六）费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费等费率，无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。
（七）基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
十五、对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称 《运作办法》）、《证券投资基金销售管理方法》（以下简称 《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2015年6月18日刊登的国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：
1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及投资组合报告的截止日期。
2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的信息。
3、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的信息。
4、在“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构及会计事务所的信息。
5、在“八、基金的投资”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
6、在“九、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
7、在“二十一、其他应披露事项”部分，更新披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。
上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录国投瑞银基金管理有限公司网站www.ubssdic.com。

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一五年十二月十八日