

国投瑞银医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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，并对内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人国投瑞银基金管理有限公司根据本基金合同的规定，于2016年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告和基金管理人报告。

基金管理人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，不保证基金净值一定盈利。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。投资者投资有风险，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。

节。本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银医疗保健混合

基金代码 000623

基金运作方式 灵活配置开放式

基金合同生效日 2014年9月25日

报告期末基金份额总额 182,774,990.04份

在符合基金合同约定的前提下，本基金通过股票与债券资产的合理配置，精选医疗保健产业及其相关行业的优质上市公司进行投资，力争为投资者带来长期的超额回报。

投资目标

本基金的投资策略是通过行业研究、精选、集中投资于医疗保健产业及其相关行业的优质上市公司，力求实现基金资产的长期增值。

（一）行业配置策略

本基金通过对医疗保健产业及相关行业进行研究、精选、集中投资于医疗保健产业及其相关行业的优质上市公司，力求实现基金资产的长期增值。

（二）个股选择策略

本基金采用自上而下的行业分类法，通过行业筛选、集中投资于医疗保健产业及其相关行业的优质上市公司，力求实现基金资产的长期增值。

（三）债券投资策略

本基金采用自下而上的行业分类法，通过行业筛选、集中投资于医疗保健产业及其相关行业的优质上市公司，力求实现基金资产的长期增值。

（四）风险管理策略

本基金将对组合的风险敞口进行定期评估，综合考虑组合的预期收益、风险承受能力、资产配置比例、投资品种的流动性等因素，对组合进行动态调整。

（五）资产支持证券投资策略

本基金将根据资产支持证券的信用评级、发行主体的资质、期限、利率水平、流动性等因素，综合分析资产支持证券的预期收益、风险、流动性等特征，选择信用等级高、流动性好、期限合理的资产支持证券进行投资。

（六）股指期货投资策略

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、股指期货的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析股指期货的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的股指期货品种进行投资。

（七）权证投资策略

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、权证的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析权证的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的权证品种进行投资。

（八）资产配置策略

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、资产配置比例、投资品种的流动性等因素，综合分析资产配置的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的资产配置品种进行投资。

（九）其他金融工具投资策略

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他金融工具的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他金融工具的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他金融工具品种进行投资。

（十）现金管理策略

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、现金管理品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析现金管理品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的现金管理品种进行投资。

（十一）其他

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他投资品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他投资品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他投资品种进行投资。

（十二）投资限制

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、投资限制的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析投资限制的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的投资限制品种进行投资。

（十三）投资组合限制

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、投资组合限制的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析投资组合限制的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的投资组合限制品种进行投资。

（十四）禁止行为

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、禁止行为的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析禁止行为的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的禁止行为品种进行投资。

（十五）关联交易定价政策

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、关联交易定价政策的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析关联交易定价政策的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的关联交易定价政策品种进行投资。

（十六）融资融券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、融资融券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析融资融券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的融资融券品种进行投资。

（十七）资产支持证券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、资产支持证券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析资产支持证券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的资产支持证券品种进行投资。

（十八）权证

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、权证的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析权证的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的权证品种进行投资。

（十九）股指期货

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、股指期货的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析股指期货的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的股指期货品种进行投资。

（二十）其他金融工具

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他金融工具的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他金融工具的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他金融工具品种进行投资。

（二十一）现金管理

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、现金管理品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析现金管理品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的现金管理品种进行投资。

（二十二）其他

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他投资品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他投资品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他投资品种进行投资。

（二十三）投资限制

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、投资限制的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析投资限制的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的投资限制品种进行投资。

（二十四）关联交易定价政策

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、关联交易定价政策的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析关联交易定价政策的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的关联交易定价政策品种进行投资。

（二十五）融资融券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、融资融券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析融资融券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的融资融券品种进行投资。

（二十六）资产支持证券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、资产支持证券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析资产支持证券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的资产支持证券品种进行投资。

（二十七）权证

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、权证的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析权证的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的权证品种进行投资。

（二十八）股指期货

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、股指期货的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析股指期货的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的股指期货品种进行投资。

（二十九）其他金融工具

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他金融工具的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他金融工具的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他金融工具品种进行投资。

（三十）现金管理

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、现金管理品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析现金管理品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的现金管理品种进行投资。

（三十一）其他

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他投资品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他投资品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他投资品种进行投资。

（三十二）投资限制

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、投资限制的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析投资限制的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的投资限制品种进行投资。

（三十三）关联交易定价政策

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、关联交易定价政策的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析关联交易定价政策的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的关联交易定价政策品种进行投资。

（三十四）融资融券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、融资融券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析融资融券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的融资融券品种进行投资。

（三十五）资产支持证券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、资产支持证券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析资产支持证券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的资产支持证券品种进行投资。

（三十六）权证

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、权证的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析权证的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的权证品种进行投资。

（三十七）股指期货

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、股指期货的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析股指期货的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的股指期货品种进行投资。

（三十八）其他金融工具

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他金融工具的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他金融工具的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他金融工具品种进行投资。

（三十九）现金管理

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、现金管理品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析现金管理品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的现金管理品种进行投资。

（四十）其他

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他投资品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他投资品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他投资品种进行投资。

（四十一）投资限制

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、投资限制的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析投资限制的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的投资限制品种进行投资。

（四十二）关联交易定价政策

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、关联交易定价政策的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析关联交易定价政策的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的关联交易定价政策品种进行投资。

（四十三）融资融券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、融资融券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析融资融券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的融资融券品种进行投资。

（四十四）资产支持证券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、资产支持证券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析资产支持证券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的资产支持证券品种进行投资。

（四十五）权证

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、权证的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析权证的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的权证品种进行投资。

（四十六）股指期货

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、股指期货的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析股指期货的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的股指期货品种进行投资。

（四十七）其他金融工具

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他金融工具的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他金融工具的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他金融工具品种进行投资。

（四十八）现金管理

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、现金管理品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析现金管理品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的现金管理品种进行投资。

（四十九）其他

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、其他投资品种的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析其他投资品种的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的其他投资品种进行投资。

（五十）投资限制

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、投资限制的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析投资限制的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的投资限制品种进行投资。

（五十一）关联交易定价政策

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、关联交易定价政策的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析关联交易定价政策的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的关联交易定价政策品种进行投资。

（五十二）融资融券

本基金将根据宏观经济运行状况、市场资金面情况、融资融券的波动性、交易成本、保证金要求等因素，综合分析融资融券的预期收益、风险、流动性等特征，选择流动性好、交易成本低的融资融券品种进行投资。

（五十三）资产支持证券