

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金(LOF)

[2017]第一季度报告

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:二〇一七年四月二十二日

5.1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等人员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。基金托管人对本报告复核无误。本报告不构成投资建议，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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

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:二〇一七年四月二十二日

5.2 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 326,530,300.07 54.40

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 6,547,772.00 1.09

F 批发和零售业 8,096,921.20 1.36

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 44,223,769.03 7.37

J 金融业 73,126,439.02 12.18

K 房屋建筑业 29,506,737.62 4.93

L 租赁和商务服务业 7,262,547.21 1.21

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 15,410,741.60 2.57

O 固定资产购置、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 17,762,118.57 2.96

S 综合 - -

合计 664,106,464.99 92.31

5.3 基金简称

国投瑞银深证100指数(LOF)

场内简称 深证100

交易代码 161227 (场内)

基金的运作方式 上市开放式

基金的合同期 2015年8月11日

报告期末基金份额总额 658,301,362.05份

投资目标 本基金通过投资于深证100指数成份股及具备相似投资特征的股票而使本基金净值的90%以上投资于深证100指数成份股,并力争在风险调整后收益方面超越深证100指数成份股平均收益率的0.03%以内,从而实现本基金的投资目标。

投资策略 本基金主要投资于深证100指数成份股及具备相似投资特征的股票,并力争在风险调整后收益方面超越深证100指数成份股平均收益率的0.03%以内,从而实现本基金的投资目标。

5.4 投资策略

本基金通过投资于深证100指数成份股及具备相似投资特征的股票而使本基金净值的90%以上投资于深证100指数成份股,并力争在风险调整后收益方面超越深证100指数成份股平均收益率的0.03%以内,从而实现本基金的投资目标。

5.5 主要财务指标

报告期:2017年1月1日至2017年3月31日 单位:人民币元

1.本期已实现收益 -7,376,115.37

2.本期利润 27,362,169.46

3.加权平均基金份额净值 0.9935

4.期末基金资产净值 600,244,964.07

5.期末基金份额净值 0.911

注:本基金报告期末未分配利润按比例分摊后的期末可供分配利润为0.0250元,期末可供基金净值0.90%,期末可供基金净值比例0.90%。

6.本期基金份额变动情况

注:本基金的报告期没有发生基金份额变动情况。

7.本期利润构成情况

注:本基金的报告期没有发生利润构成情况。

8.期末基金资产净值

注:本基金的报告期没有发生期末基金资产净值情况。

9.期末基金份额净值

注:本基金的报告期没有发生期末基金份额净值情况。

10.本期基金份额变动情况

注:本基金的报告期没有发生本期基金份额变动情况。

11.本期利润构成情况

注:本基金的报告期没有发生本期利润构成情况。

12.期末基金份额净值

注:本基金的报告期没有发生期末基金份额净值情况。

13.主要财务指标

注:本基金的报告期没有发生主要财务指标情况。

14.基金净值表现

注:本基金的报告期没有发生基金净值表现情况。

15.管理人报告

注:本基金的报告期没有发生管理人报告情况。

16.基金的财务指标

注:本基金的报告期没有发生基金的财务指标情况。

17.基金的净值表现

注:本基金的报告期没有发生基金的净值表现情况。

18.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

19.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

20.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

21.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

22.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

23.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

24.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

25.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

26.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

27.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

28.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

29.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

30.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

31.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

32.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

33.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

34.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

35.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

36.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

37.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

38.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

39.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

40.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

41.基金的财务指标

注:本基金的报告期没有发生基金的财务指标情况。

42.基金的净值表现

注:本基金的报告期没有发生基金的净值表现情况。

43.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

44.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

45.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

46.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

47.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

48.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

49.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

50.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

51.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

52.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

53.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

54.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

55.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

56.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

57.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

58.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

59.基金的负债净值

注:本基金的报告期没有发生基金的负债净值情况。

60.基金的资产净值与负债净值的差额

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值与负债净值的差额情况。

61.基金的资产净值

注:本基金的报告期没有发生基金的资产净值情况。

<div data-bbox="14 1452 234 1463" data-label="