

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF)

招募说明书摘要

(2016 年 3 月更新)

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

【重要提示】

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）由国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作期届满转型而成。

《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》于2012年7月17日生效，并于2012年8月14日进入为期三年的分级运作期。在分级运作期内，瑞福优先份额自分级运作期开始后每满6个月开放一次，接受投资者的申购与赎回；瑞福进取份额在深圳证券交易所上市交易。国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金的三年分级运作期于2015年8月13日届满。

根据《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在分级运作三年期届满，无需召开基金份额持有人大会，基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）”。转换为上市开放式基金（LOF）时，瑞福优先份额资产将以现金形式给付，瑞福进取份额资产则转入国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）。转换为上市开放式基金（LOF）后，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序不变。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪基准指数。本基金投资于深证 100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 80%；投资于标的指数成份股

票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化、基金份额上市交易价格波动引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书摘要所载内容截止日期为2016年1月17日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2015年12月31日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司于2016年2月14日对本招募说明书摘要（2016年3月更新）进行了复核。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国投瑞银基金管理有限公司

英文名称：UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD

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

设立日期：2002 年 6 月 13 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】25 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：杨蔓

客服电话：400-880-6868

传 真：(0755) 82904048

股权结构：

股东名称	持股比例
国投泰康信托有限公司	51%
瑞士银行股份有限公司 (UBS AG)	49%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

叶柏寿先生，董事长，中国籍，经济学学士，现任国家开发投资公司副总经济师、国投资本控股有限公司董事长（法定代表人）、国投泰康信托有限公司董事长（法定代表人）、国投财务有限公司董事、国投电力控股股份有限公司监事会主席、国投融资租赁有限公司董事长。曾任国家计委经济研究所干部、研究室副主任，国家开发投资公司财务会计部干部、处长、副主任、主任，国

投资本控股有限公司副董事长。

凌新源先生，董事，中国籍，硕士，高级经济师。现任瑞士银行（香港）环球资产管理公司董事总经理，中国区主席。曾任华夏基金管理有限公司董事长，北京证券有限公司董事长，华夏证券有限公司执行副总裁，中国钢铁工贸集团公司总裁助理，中国冶金进出口总公司总裁助理，北京国际信托投资公司业务部副经理。

王彬女士，总经理，董事，中国籍，香港中文大学工商管理硕士，高级经济师，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长及国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书、国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、国投泰康信托有限公司资产管理部经理兼董事会秘书，北京京能热电股份有限公司董事会秘书、北京国际电力开发投资公司董事会秘书、北京市人民政府新闻处主任科员、北京天然气联合公司职员。

董日成先生，董事，中国香港籍，英国 Sheffield 大学学士，现任瑞银环球资产管理公司中国区董事总经理，兼任国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事。曾任瑞银环球资产管理公司中国区业务经理、执行董事，瑞银环球资产管理对冲基金亚太区首席营运官，瑞银环球资产管理台湾总经理，香港瑞银财富管理部门主管，国投瑞银基金管理有限公司代总经理和首席营运官，美林投资经理人公司亚太地区首席营运官，美国国际集团亚太地区的金融及营运领域担任多个重要职务等。

刘纯亮先生，董事，中国籍，经济学学士，中国注册会计师协会和特许公认会计师公会（ACCA）会员，曾任北京建工集团总公司会计，柏德豪（BDO）关黄陈方国际会计师行会计师，中国证券监督管理委员会稽查部科员，博时基金管理有限公司监察法律部负责人、督察长，国投瑞银基金管理有限公司副总经理、总经理，国投瑞银资本管理有限公司董事长，国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事长。

李哲平先生，独立董事，中国籍，金融学硕士，现任当代金融家杂志社主编、中信银行独立董事、中航证券有限公司独立董事。曾任统信资产评估公司董事长、中国证券报理论版主编、中国金融培训中心助教。

史克通先生，独立董事，中国籍，法学学士，现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、律师，主要从事公司经常性业务及 IPO、上市公司再融资及重大重组、证券投资基金及私募基金的设立、投资等业务；兼任中国忠旺控股有限公司（香港主板上市）独立董事，昆山金利表面材料应用科技股份有限公司（中小板上市）独立董事，北京公共交通控股（集团）有限公司外部董事（北京市国资委任命）。曾任职于山东鲁中律师事务所、北京市京都律师事务所。

龙涛先生，独立董事，中国籍，硕士。现任北京海问投资咨询有限公司董事长，中央财经大学会计系副教授，兼任庆铃汽车股份有限公司和北辰实业股份有限公司独立董事。曾任华夏基金管理有限公司独立董事，曾在毕马威国际会计纽约分部担任审计和财务分析工作。

2、监事会成员

卢永燊先生，监事会主席，中国香港籍，工商管理硕士，现任瑞银环球资产管理公司中国区财务部主管和瑞银环球资产管理(中国)有限公司监事。曾任瑞银环球资产管理公司泛亚地区财务部主管。以往在金融服务及电信行业担任多个财务部管理职位。

展飞先生，监事，中国籍，硕士，现任国投泰康信托有限公司固有业务总部负责人。曾任国家开发投资公司战略发展部一级项目经理助理，国投信托有限公司信托资产运营部和信托资产管理部项目经理。

王明辉先生，监事，中国籍，经济学硕士，特许金融分析师协会会员、全球风险协会会员，拥有特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)、国际注册内部审计师(CIA)资格。现任国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部总监。曾任职国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部副总监、国泰君安证券股份有限公司稽核审计总部审计总监。

冯伟女士，监事，中国籍，经济学硕士，高级会计师。现任国投瑞银基金管理有限公司总经理助理。曾任职中融基金管理有限公司清算主管，深圳投资基金管理有限公司投研人员。

3、公司高级管理人员及督察长

王彬女士，总经理，董事，中国籍，香港中文大学工商管理硕士，高级经济师，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长及国投瑞银资产管理（香港）有

限公司董事。曾任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书、国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、国投泰康信托有限公司资产管理部经理兼董事会秘书，北京京能热电股份有限公司董事会秘书、北京国际电力开发投资公司董事会秘书、北京市人民政府新闻处主任科员、北京天然气联合公司职员。

王书鹏先生，副总经理，中国籍，北京航空航天大学工程硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司总经理及董事。曾任职内蒙古哲盟交通规划设计院，内蒙古自治区交通收费稽查局哲盟分局，北京拓宇交通通用设施有限公司财务经理，利安达信隆会计师事务所项目经理，国投信托有限公司财务、信托资产运营管理部门经理。

张南森先生，副总经理，中国籍，北京大学高级管理人员工商管理硕士。曾任湘财证券有限公司营业部总经理助理，银华基金管理有限公司市场营销部执行主管，中邮创业基金管理有限公司机构理财部副总经理，国投瑞银基金管理有限公司机构服务部总监、总经理助理。

袁野先生，副总经理，中国籍，复旦大学工商管理硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司副总经理。曾任深圳投资基金管理公司基金经理，国信证券基金债券部投资经理，国投瑞银基金管理有限公司基金经理、基金投资部总监，招商基金管理有限公司总经理助理。

刘凯先生，督察长，中国籍，复旦大学工商管理学硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事。曾任尊荣集团证券投资项目经理，君安证券东门南营业部研究员，平安证券蛇口营业部投资顾问，招商基金管理有限公司客户服务部总监，国投瑞银基金管理有限公司市场服务部总监、总经理助理。

4、本基金基金经理

赵建先生，中国籍，同济大学管理学博士。13 年证券从业经历，曾任上海博弘投资有限公司、上海数君投资有限公司高级软件工程师、风控经理，上海一维科技有限公司研发工程师。2010 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司。2013 年 4 月 2 日起任国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金的基金经理助理，2013 年 5 月 17 日起任国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）的基金经理助理，2013 年 9 月 26 日起任国投瑞银瑞福深证 100 指

数证券投资基金（LOF）（原国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金）基金经理，2014 年 4 月 25 日起兼任国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 2 月 10 日起兼任国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原国投瑞银沪深 300 金融地产指数基金）基金经理，2015 年 3 月 17 日起兼任国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日起兼任国投瑞银白银期货证券投资基金（LOF）基金经理。

本基金历任基金经理：

黄顺祥先生，2012 年 7 月 17 日（本基金基金合同生效日）至 2012 年 10 月 29 日；

朱红裕先生，2012 年 7 月 17 日（本基金基金合同生效日）至 2012 年 10 月 29 日；

LU RONG QIANG 先生，2012 年 10 月 30 日至 2015 年 2 月 9 日。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

（1）投资决策委员会召集人：袁野先生，副总经理

（2）投资决策委员会成员：

韩海平先生：总经理助理兼固定收益部总监

李怡文女士：固定收益部副总监，基金经理

何明女士：研究部总监

蒋旭东先生：总经理助理，量化投资部负责人

杨俊先生：交易部总监

马少章先生：专户投资部副总监，投资经理

汤海波先生：国际业务部副总监，基金经理

陈小玲女士：基金投资部副总监，基金经理

杨冬冬先生，基金投资部副总监，基金经理

（3）总经理和督察长列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

二、主要人员情况

截至 2015 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2015 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 496 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、场外直销机构：国投瑞银基金管理有限公司直销中心

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)83575993 83575995

传真：(0755)82904048 82904007

联系人：贾亚莉、曹丽丽

客服电话：400-880-6868

网站：www.ubssdic.com

2、场外代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

传真：010-66107914

联系人：杨菲

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

(2) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：王琳

客服电话：95533

网站: www.ccb.com

(3) 交通银行股份有限公司

住所: 上海市银城中路 188 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

电话: 021-58781234

传真: 021-58408483

联系人: 曹榕

客服电话: 95559

公司网站: www.bankcomm.com

(4) 招商银行股份有限公司

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 李建红

电话: 0755-83198888

传真: 0755-83195049

联系人: 邓炯鹏

客服电话: 95555

公司网站: www.cmbchina.com

(5) 平安银行股份有限公司

住所: 广东省深圳市深南东路 5047 号

办公地址: 广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人: 孙建一

联系人: 张莉

电话: 021-38637673

传真: 021-50979507

客服电话: 95511-3

公司网站: bank.pingan.com

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：高天 虞谷云

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(7) 国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

公司网站：www.gtja.com

(8) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

(9) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼

法定代表人：何如

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133952

联系人: 周杨

客服电话: 95536

公司网站: www.guosen.com.cn

(10) 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人: 宫少林

电话: 0755-82943666

传真: 0755-83734343

联系人: 黄婵君

客服电话: 95565、4008888111

公司网站: www.newone.com.cn

(11) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈有安

电话: 010-66568450

传真: 010-66568990

联系人: 宋明

客服电话: 400-888-8888

公司网站: www.chinastock.com.cn

(12) 海通证券股份有限公司

住所: 上海市广东路 689 号

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客服电话: 95553

公司网站: www.htsec.com

(13) 申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 (邮编: 200031)

法定代表人: 李梅

电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

联系人: 曹晔

客服电话: 95523 或 4008895523

公司网站: www.swhysc.com

(14) 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

(15) 兴业证券股份有限公司

住所: 福州市湖东路 268 号

办公地址: 浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人: 兰荣

电话: 0591-38281978

传真: 0591-38507538

联系人: 林武能

客服电话: 95562

公司网站: www.xyzq.com.cn

(16) 安信证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人: 牛冠兴

电话: 0755-82558305

传真: 0755-82558355

联系人: 陈剑虹

客服电话: 4008-001-001

公司网站: www.essence.com.cn

(17) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

联系人: 李芳芳

客服电话: 95525、4008888788

公司网站: www.ebscn.com

(18) 平安证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

电话: 0755-22621866

传真: 0755-82400862

联系人: 吴琼

客服电话: 95511-8

公司网站: www.pingan.com

(19) 国盛证券有限责任公司

住所：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：曾小普

电话：0791-86283080

传真：0791-86288690

联系人：俞驰

客服电话：4008222111

公司网站：www.gsstock.com

(20) 华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

联系人：汪燕、范超

客服电话：96518（安徽）、4008096518（全国）

公司网站：www.hazq.com

(21) 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

(22) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人: 杨宝林

电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

联系人: 吴忠超

客服电话: 95548

公司网站: www.citicssd.com

(23) 中泰证券股份有限公司

住所: 山东省济南市经七路 86 号

办公地址: 济南市经七路 86 号

法定代表人: 李玮

电话: 021-20315255

传真: 021-20315137

联系人: 马晓男

客服电话: 95538

公司网站: www.qlzq.com.cn

(24) 第一创业证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

办公地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人: 刘学民

电话: 0755-23838750

传真: 0755-23838750

联系人: 毛诗莉

客服电话: 400-888-1888

公司网站: www.firstcapital.com.cn

(25) 长城证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人: 黄耀华

电话: 0755-83516289

传真: 0755-83515567

联系人: 刘阳

客服电话: 0755-33680000、400-6666-888

公司网站: www.cgws.com

(26) 渤海证券股份有限公司

住所: 天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址: 天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人: 王春峰

电话: 022-28451991

传真: 022-28451958

联系人: 蔡霆

客服电话: 400-651-5988

公司网站: www.bhzq.com

(27) 山西证券股份有限公司

住所: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

电话: 0351-8686659

传真: 0351-8686619

联系人: 郭熠

客服电话: 95573、400-666-1618

公司网站: www.i618.com.cn

(28) 广州证券股份有限公司

住所: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、
20 层

法定代表人: 邱三发

电话: 020-88836999

传真: 020-88836920

联系人: 梁薇

客服电话: 961303

公司网站: www.gzs.com.cn

(29) 中国中投证券有限责任公司

住所: 深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址: 深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

电话: 0755-82023442

传真: 0755-82026539

联系人: 刘毅

客服电话: 400-600-8008、95532

公司网站: www.china-invs.cn

(30) 东莞证券股份有限公司

住所: 东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址: 东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人: 张运勇

电话: 0769-22115712

传真: 0769-22115712

联系人: 李荣

客服电话: 0769-961130

公司网站: www.dgzq.com.cn

(31) 东海证券股份有限公司

住所: 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人: 朱科敏

电话: 021-20333333

传真: 021-50498825

联系人: 王一彦

客服电话: 95531; 400-888-8588

公司网站: www.longone.com.cn

(32) 上海证券有限责任公司

住所: 上海市西藏中路 336 号

办公地址: 上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人: 龚德雄

电话: 021-53686888

传真: 021-53686100, 021-53686200

联系人: 许曼华

客服电话: 021-962518

公司网站: www.962518.com

(33) 国都证券股份有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 常喆

电话: 010-84183333

传真: 010-84183311

联系人: 黄静

客服电话: 400-818-8118

公司网站: www.guodu.com

(34) 国金证券股份有限公司

住所: 成都市东城根上街 95 号

办公地址: 成都市东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云

电话: 028-86690057

传真: 028-86690126

联系人: 刘婧漪

客服电话: 4006-600109

公司网站: www.gjzq.com.cn

(35) 万联证券有限责任公司

住所: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人: 张建军

联系电话: 020-38286588

传真: 020-22373718-1013

联系人: 王鑫

客服电话: 400-8888-133

网址: www.wlzq.com.cn

(36) 江海证券有限公司

住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

电话: 0451-85863726

传真: 0451-82337279

联系人: 周俊

客服电话: 400-666-2288

公司网站: www.jhzq.com.cn

(37) 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

(38) 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: 95321

公司网站: www.cindasc.com

(39) 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

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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: 0752-2119396

联系人: 彭莲

客户服务电话: 95564

公司网址: www.lxzq.com.cn

(49) 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

(50) 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: www.txsec.com

天相基金网网址: www.jjm.com.cn

(51) 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

(52) 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: 单丙焯

电话: 021-20691832

传真: 021-20691861

客服电话: 400-820-2899

公司网站: www.erichfund.com

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(62) 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

(63) 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

(64) 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

(65) 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: 021-20665952

传真: 021-22066653

客户服务电话: 4008219031

网址: www.lufunds.com

3、场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位:
包括: 国泰君安、广发证券、国信证券、招商证券、中信证券、海通证券、申

银万国、西南证券、华龙证券、大同证券、民生证券、山西证券、长江证券、中信万通证券、广州证券、兴业证券、华泰证券、渤海证券、中信证券 (浙江)、万联证券、国元证券、湘财证券、东吴证券、东方证券、光大证券、上海证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、东北证券、南京证券、长城证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、恒泰证券、中银国际证券、齐鲁证券、华西证券、国盛证券、新时代证券、华林证券、中金公司、宏源证券、华福证券、世纪证券、德邦证券、金元证券、西部证券、东海证券、信泰证券、中航证券、第一创业证券、中信建投证券、财通证券、安信证券、银河证券、华鑫证券、瑞银证券、国金证券、中投证券、中山证券、红塔证券、日信证券、西藏证券、方正证券、联讯证券、江海证券、银泰证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、爱建证券、英大证券等。

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：北京西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：(010) 59378856

传真：(010) 59378907

联系人：崔巍

三、出具法律意见书的律师事务所

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

联系人：宋萍萍

电话：(010) 58785588

传真：（010）58785599

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)

注册地址：中国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：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心
11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：陈玲、曹阳

第四部分 基金的名称

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）

第五部分 基金的类型

本基金类型：股票型。基金运作方式：上市契约型开放型（LOF）。

第六部分 基金的投资目标

本基金的投资目标：本基金通过被动的指数化投资管理，实现对深证 100 价格指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

第七部分 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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于深证 100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、

卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。

当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况（如股权分置改革等）导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。

(1) 类别资产配置

本基金采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在股票和其他资产之间的配置比例，然后通过指数复制的方法，确定各成份股的配置比例。

(2) 股票组合构建与调整

1) 股票组合构建

本基金采用指数复制构建股票组合中将使用以下模型：

$$Vol_{i,t} = Weight_{i,t} \times Netvalue_t \div Price_{i,t}$$

上式中：

$Vol_{i,t}$ 为本基金对深证 100 指数中所有成份股在 t 时刻配置的股票数量；

$Weight_{i,t}$ 为深证 100 指数中第 i 个成份股 t 时刻在指数中所占的权重；

$Netvalue_t$ 为本基金在 t 时刻的股票配置总额；

$Price_{i,t}$ 为深证 100 指数中第 i 个成份股在 t 时刻的市场价格。

2) 股票组合调整

根据基准指数成份股及其权重的变动、法律法规中的投资比例限制、增发新股等情形，对股票投资组合及时进行适度调整。

①基于基准指数成份股及其权重变动的调整

②成份股流动受限时的调整

③成份股基本面发生重大不利变化时的调整

为保护基金份额持有人利益，当某成份股基本面发生重大不利变化，预计将被剔除出成份股时，本基金将提前调降该成份股的配置权重，并用替代股票进行替代，也可根据指数编制规则前瞻性地预测入选股票来作为备选替代股票。

④一般情况下，本基金仅参与有望入选指数成份股的 IPO 新股申购以及成份股内增发新股的申购。但考虑到国内新股发行上市的市场特点，本基金也参与申购收益率较高的品种，由此得到的非成份股将择机卖出。

⑤为有效控制基金的跟踪误差，在市场条件允许的情况下，本基金可能投资于金融衍生工具，以对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

（3）股指期货的投资

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，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

$95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

深证 100 价格指数由深圳证券信息公司编制发布，其成份股由在深圳证券交易所上市、公司平均流通市值的比重和平均成交金额的比重排名在前 100 名

的股票构成, 对深圳 A 股市场有很强的代表性。

由于本基金的投资标的为深证 100 指数成份股及备选股, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%, 因此, 本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率 (税后)}$ 。

如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时, 基金管理人和基金托管人协商一致后可以变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 基金的风险收益特征

从基金资产整体运作来看, 本基金为股票型基金, 属于高风险、高收益的基金品种, 基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2015 年 12 月 31 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	940,357,798.19	93.13
	其中: 股票	940,357,798.19	93.13
2	基金投资	—	—
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	66,560,623.89	6.59
8	其他资产	2,806,998.00	0.28
9	合计	1,009,725,420.08	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

2、按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末 (指数投资) 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	1,651,214.00	0.16
B	采矿业	7,459,664.00	0.74
C	制造业	470,304,257.01	46.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,217,289.92	0.42
E	建筑业	2,962,648.00	0.30
F	批发和零售业	25,804,161.23	2.57
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	128,543,172.01	12.82
J	金融业	133,531,407.50	13.32
K	房地产业	117,855,330.57	11.75
L	租赁和商务服务业	574.47	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	20,547,145.89	2.05
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	19,213,945.59	1.92
S	综合	8,266,988.00	0.82

	合计	940,357,798.19	93.79
--	----	----------------	-------

(2) 报告期末 (积极投资) 按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

3、按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 期末指数投资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	000002	万科 A	2,392,794	58,455,957.42	5.83
2	000651	格力电器	1,586,409	35,456,241.15	3.54
3	000876	新希望	1,802,450	31,777,193.50	3.17
4	300059	东方财富	523,071	27,215,384.13	2.71
5	002450	康得新	647,552	24,671,731.20	2.46
6	000001	平安银行	2,056,441	24,656,727.59	2.46
7	001979	招商蛇口	1,117,784	23,316,974.24	2.33
8	000725	京东方 A	7,583,476	22,522,923.72	2.25
9	000783	长江证券	1,710,939	21,249,862.38	2.12
10	300104	乐视网	331,721	19,962,969.78	1.99

(2) 积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、按券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、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

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

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，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末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) 其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,696,053.78
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	13,699.14

5	应收申购款	97,245.08
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,806,998.00

(4) 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处于转股期的可转债。

(5) 期末指数投资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	000002	万科 A	58,455,957.42	5.83	重大事项停牌
2	000876	新希望	31,777,193.50	3.17	重大事项停牌
3	300104	乐视网	19,962,969.78	1.99	重大事项停牌

(6) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

第十二部分 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：

转型前：国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金

国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资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 8 月 13 日）

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	--------	--------	-----------	------------	-----	-----

		准差②	③	准差④		
2012. 08. 14 （国投瑞银瑞 福深证 100 指 数分级证券投 资基金分级运 作起始日） 至 2012. 12. 31	1. 20%	1. 37%	0. 97%	1. 36%	0. 23%	0. 01%
2013. 01. 01 至 2013. 12. 31	-4. 38%	1. 35%	-4. 53%	1. 35%	0. 15%	0. 00%
2014. 01. 01 至 2014. 12. 31	30. 09%	1. 15%	30. 59%	1. 15%	-0. 50%	0. 00%
2015. 01. 01 至 2015. 8. 13	24. 17%	2. 58%	26. 52%	2. 45%	-2. 35%	0. 13%
自国投瑞银瑞 福深证 100 指 数分级证券投 资基金分级运 作起始日至 2015. 8. 13	56. 30%	1. 63%	59. 26%	1. 58%	-2. 96%	0. 05%

注：1、由于本基金的投资标的为深证100指数成份股及备选股，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，因此，本基金将业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金的三年分级运作期于2015年8月13日届满，基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）”，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序不变。

转型后：国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）

国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金（LOF）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 12 月 31 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
自基金合同生效日 (2015.8.14) 至今	1.95%	2.72%	-4.28%	2.49%	6.23%	0.23%

注：1、由于本基金的投资标的为深证100指数成份股及备选股，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，因此，本基金将业绩比较基准定为95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

第十三部分 费用概览

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金标的指数使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。

管理费的计算方法如下:

$$H = E \times \text{管理费比例} \div \text{当年天数}$$

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

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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。

托管费的计算方法如下:

$$H = E \times \text{托管费比例} \div \text{当年天数}$$

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

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、公休假等, 支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金, 需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本基金转型前的分级运作期起始日起开始计提, 每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二, 按季支付, 自转型前的分级运作期起始日所在季度的下一季度起, 指数使用费收取下限为每季度人民币 5 万元, 即若不足人民币 5 万元则按照人民币 5 万元收取。

指数使用费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从本基金转型前的分级运作期起始日开始每日计算, 逐日累计。

指数使用费每日计提, 逐日累计, 按季支付, 由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令, 基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

在基金存续期内, 如果基金管理人与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议中关于“指数使用费”的内容有所修改的, 将按照最新的内容进行费用计提和支付, 此事无须召开份额持有人大会。

4、上述一、基金费用的种类中第 4—8 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、《基金合同》生效前的相关费用, 包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、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) 申购费用

本基金的场外前端申购费率如下表:

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

本基金的场外后端申购费率如下表:

持有时间 (T)	后端申购费率
T < 1 年	1.4%
1 年 ≤ T < 2 年	1.0%

2 年 ≤ T < 3 年	0.5%
T ≥ 3 年	0

本基金的场内申购费率由基金代销机构比照场外前端申购费率执行。

(2) 赎回费用

本基金的场外赎回费率如下表：

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

注：1 年按 365 天来计算。

本基金的场内赎回费率固定为 0.5%。

(3) 本基金的申购费用和赎回费用由基金申购人承担。申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用；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资产。

五、与基金销售有关的费用的计算

1、基金份额申购份额的计算

基金申购采用金额申购的方式。基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。本基金场外申购时投资者可以选择支付前端申购费用或者后端申购费用。本基金场内申购时投资者仅能选择支付前端申购费用。

(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：

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额的基金份额净值}$$

(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：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}；$$

当投资人提出赎回时，后端申购费用的计算方式为：

$$\text{后端申购费用} = \text{赎回份额} \times \text{申购当日基金份额净值} \times \text{后端申购费率}$$

2、基金份额赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日基金份额的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

(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×赎回当日基金份额的基金份额净值

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

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。

调高基金管理费率、基金托管费率，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 日在指定媒体上公告。

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。

第十四部分 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办法》（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8月28日刊登的本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“第三部分、基金管理人”，更新了基金管理人的信息。
- 3、在“第四部分、基金托管人”，更新了基金托管人的信息。
- 4、在“第五部分、相关服务机构”，更新了场外代销机构和会计师事务所的信息。
- 5、在“第八部分、基金份额的申购与赎回”，更新了申购赎回的数额限制，增加了发生指数熔断期间对基金申购、赎回开放时间调整的说明。
- 6、在“第九部分、基金的投资”，更新了本基金最近一期投资组合报告等内容。
- 7、在“第十部分、基金的业绩”，更新了基金合同生效以来的投资业绩。
- 8、在“第二十二部分、其他应披露事项”，更新披露了自上次招募说明书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

二〇一六年三月一日