

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF)
2017 年年度报告摘要
2017 年 12 月 31 日

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：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银深证 100 指数 (LOF)	
场内简称	深证 100	
基金主代码	161227	
交易代码	161227(前端)	161228(后端)
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 8 月 14 日	
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	
报告期末基金份额总额	476,427,387.34 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	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。
业绩比较基准	95%×深证 100 价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘凯	郭明
	联系电话	400-880-6868	010-66105799
	电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人 互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 46 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 8 月 14 日
---------------	--------	--------	-----------------

			(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	48,716,329.36	-41,763,532.99	722,242,060.59
本期利润	108,417,968.50	-139,798,951.05	-1,143,084,947.93
加权平均基金份额本期 利润	0.1843	-0.1666	-0.5235
本期基金份额净值增长 率	21.10%	-13.58%	1.95%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额 利润	-0.1588	-0.3432	-0.2065
期末基金资产净值	503,190,438.91	617,994,814.04	1,002,643,395.81
期末基金份额净值	1.056	0.872	1.009

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
过去三个月	3.94%	1.07%	5.58%	1.09%	-1.64%	-0.02%
过去六个月	9.43%	0.90%	11.45%	0.93%	-2.02%	-0.03%
过去一年	21.10%	0.84%	25.02%	0.86%	-3.92%	-0.02%

自基金合同生效起至今	6.70%	1.66%	0.96%	1.52%	5.74%	0.14%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

注：1、本基金由国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金于 2015 年 8 月 14 日转型而成，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序转型前后不变。因此，本基金的业绩比较基准与转型前相同，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。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 （2015 年 8 月 14 日至 2017 年 12 月 31 日）

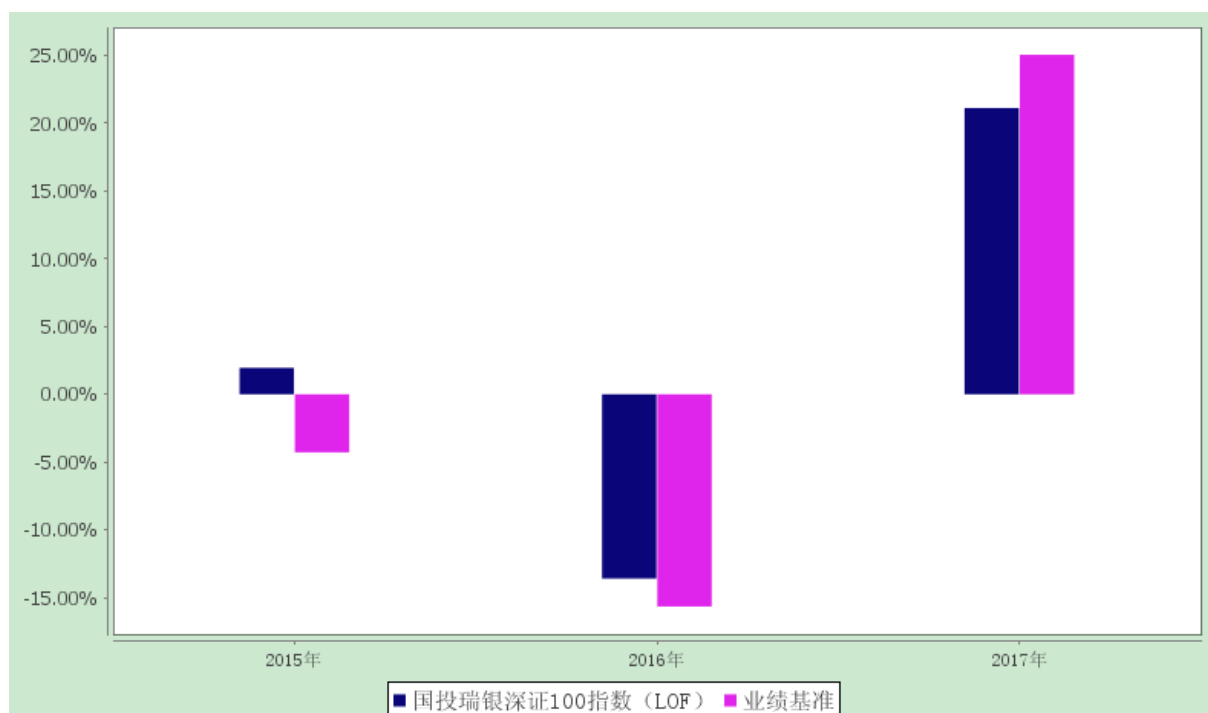


注：截至本报告期末各项资产配置比例分别为股票投资占基金净值比例 93.56%，权证投资占基金净值比例 0%，债券投资占基金净值比例 0%，现金和到期日不超过 1 年的政府债券占基金净值比例 6.79%，符合基金合同的相关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金于 2015 年 8 月 14 日转型而成。因此本基金 2015 年度净值增长率及同期业绩比较基准收益率自 2015 年 8 月 14 日起计算，不按整个自然年度进行折算。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于 2002 年 6 月 13 日正式成立，注册资本 1 亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到 49% 的合资基金管理公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制架构，以“诚信、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止 2017 年 12 月底，在公募基金方面，公司共管理 68 只基金，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自 2008 年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、商品期货、QDII 等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自 2006 年开始为 QFII 信托计划提

供投资咨询服务，具有丰富经验，并于 2007 年获得 QDII 资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵建	本基金基金经理	2013-09-26	-	14	中国籍，博士，具有基金从业资格。曾任职于上海博弘投资有限公司、上海数君投资有限公司、上海一维科技有限公司。2010 年 6 月加入国投瑞银。现任国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金 (LOF)、国投瑞银金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金和国投瑞银白银期货证券投资基金 (LOF) 基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规、《国投瑞银深证 100 指数证券投资基金基金合同》有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度，并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则：

- 1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时，坚持基金持有人利益优先；
- 2、当不同资产委托人利益发生冲突时，应公平的对待不同的资产委托人；
- 3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合；
- 4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下：

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程，提高投资管理的科学性和客观性，确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系，加强交易分配的内部控制，通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现，同时通过监察稽核，事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下：

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统，充分发挥系统的自动控制功能，根据公平交易管理的要求，在系统中设置相应业务流转顺序、控制阈值或者触发机制，对触及阈值的行为视情况分别采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务自动执行必要的后续流程。如：符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易，内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理，控制阈值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动，通过建立明确的业务规则和流程，在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制，通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求，实现对关键业务风险的管理。如：以公司名义进行的一级市场申购结果分配，需要经过严格的公平性审核，由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分

配结果无异议并签署后才为有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位，分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控，并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况，监督督促公平交易制度的执行。如：交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督，监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核，监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析，发现控制薄弱环节或交易价异常，将重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中，披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明，接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查，公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时，将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况，并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题，也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场检查等方式，也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析，并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为，将依法采取相关监管措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效的公平交易体系。本

报告期, 本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行, 未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年, 国内经济平稳运行, 房地产销售和新开工好于市场预期, 保持较快增长; 受供给侧改革和环保趋严的影响, 周期性行业的盈利大幅好转; 受金融去杠杆和国内经济向好的影响, 短端和长端资金利率上行明显。国际市场, 欧美经济强劲复苏, 美联储加息和缩表提上日程。

国内股票市场呈现结构性牛市特征, 全年沪深 300 涨幅 21.8%, 中证 500 基本持平, 而中证 1000 下跌 17.4%, 风格分化明显, 核心是盈利驱动。分行业看, 家电、食品饮料、煤炭、非银、电子等行业涨幅居前, 纺织服装、传媒、计算机、国防军工、农林牧渔跌幅居前。

基金投资操作上, 作为指数基金, 投资操作以严格控制跟踪误差为主, 研究应对成分股调整、成分股停牌替代等机会成本、同时密切关注基金日常申购、赎回带来的影响及市场出现的结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末, 本基金份额净值为 1.056 元, 基金份额净值增长率为 21.10%, 同期业绩基准为 25.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年, 全球经济景气依然较好, 国内经济在地产和外围景气双重驱动下保持景气。需要关注的风险是, 美国通胀的回升和加息的步伐对整体金融市场的影响。同时, 考虑国内稳健中性的货币政策以及金融市场去杠杆, 行业估值与景气度的匹配仍将是投资的核心考量因素。总体看, 随着经济的持续复苏, 金融地产和周期蓝筹龙

头估值继续修复，成长股中的优质公司也逐步体现出中期投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关

部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算员与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，应通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资部门、研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本期已实现收益为 48,716,329.36 元，期末可供分配利润为-75,663,610.23 元。

本报告期本基金未进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师 薛竞、陈邈迤签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20589 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表**7.1 资产负债表**

会计主体: 国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:	-	-
银行存款	32,905,538.97	42,606,388.82
结算备付金	1,249,536.10	454,792.35
存出保证金	34,102.78	28,930.79
交易性金融资产	470,783,495.24	576,383,354.31

其中：股票投资	470,783,495.24	576,383,354.31
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,863.81	8,721.04
应收股利	-	-
应收申购款	26,936.48	21,153.41
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	505,006,473.38	619,503,340.72
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	558,203.20	22,474.95
应付管理人报酬	319,687.63	406,561.24
应付托管费	63,937.51	81,312.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	203,648.99	308,155.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	670,557.14	690,022.58
负债合计	1,816,034.47	1,508,526.68
所有者权益：	-	-
实收基金	578,854,049.14	861,278,520.62
未分配利润	-75,663,610.23	-243,283,706.58
所有者权益合计	503,190,438.91	617,994,814.04
负债和所有者权益总计	505,006,473.38	619,503,340.72

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.056 元，基金份额总额 476,427,387.34 份。

7.2 利润表

会计主体：国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	117,345,982.22	-129,442,149.80
1.利息收入	273,948.63	537,476.20
其中：存款利息收入	273,948.63	522,291.47
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	15,184.73
其他利息收入	0.00	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	56,495,969.58	-33,032,765.06
其中：股票投资收益	48,920,317.01	-43,966,597.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,575,652.57	10,933,831.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	59,701,639.14	-98,035,418.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	874,424.87	1,088,557.12
减：二、费用	8,928,013.72	10,356,801.25
1. 管理人报酬	4,207,840.97	5,431,162.71
2. 托管费	841,568.11	1,086,232.52
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,229,845.64	3,150,557.41
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	648,759.00	688,848.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	108,417,968.50	-139,798,951.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	108,417,968.50	-139,798,951.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益 (基金净值)	861,278,520.62	-243,283,706.58	617,994,814.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	108,417,968.50	108,417,968.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-282,424,471.48	59,202,127.85	-223,222,343.63
其中: 1.基金申购款	12,444,931.11	-2,417,295.25	10,027,635.86
2.基金赎回款	-294,869,402.59	61,619,423.10	-233,249,979.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	578,854,049.14	-75,663,610.23	503,190,438.91
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,207,914,507.85	-205,271,112.04	1,002,643,395.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-139,798,951.05	-139,798,951.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-346,635,987.23	101,786,356.51	-244,849,630.72

”号填列)			
其中：1.基金申购款	38,178,593.50	-10,692,085.17	27,486,508.33
2.基金赎回款	-384,814,580.73	112,478,441.68	-272,336,139.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	861,278,520.62	-243,283,706.58	617,994,814.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王彬，主管会计工作负责人：王彬，会计机构负责人：冯伟

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)是由国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金(以下简称“原基金”)分级运作期届满转型而来。原基金的基金合同于 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。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》的相关规定，原基金分级运作期届满后，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金(LOF)。原基金的三年分级运作期已于 2015 年 8 月 13 日到期，根据《瑞福深证 100 指数分级基金分级运作期届满基金名称变更的公告》，自 2015 年 8 月 14 日起，原基金的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)(以下简称“本基金”)。根据《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级基金分级运作期届满瑞福优先现金给付及瑞福进取份额转换结果的公告》，在份额转换基准日 2015 年 8 月 13 日日终，原基金优先级基金份额以基金份额净值 1.028513698 元为基准进行了现金给付；原基金进取级基金份额按照份额转换基准日的份额数等额转换为本基金份额，转换后本基金总份额数为 3,645,807,269.28 份。本基金的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。

根据《国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金招募说明书》和《关于国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)份额折算结果的公告》，本基金以 2015 年 8 月 17 日为份额折算基准日进行份额折算。折算前基金份额总额为 3,645,807,269.28 份，折算前基金份额净值为 1.892 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 1.891553256，折算后基金份额总额为 6,896,238,610.60 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。

经深圳交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]401 号文审核同意，本基金 6,873,263,250.00 份基金份额于 2015 年 8 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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，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。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自 2017 年 11 月 13 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全

面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。

(6) 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税

行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外, 财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国投泰康信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东
国投瑞银资本管理有限公司	基金管理人的子公司
安信证券股份有限公司(“安信证券”)	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构
国投瑞银资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司

注: 1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 本报告期内, 本基金新增与国投瑞银受同一实际控制的关联方安信证券股份有限公司。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例

安信证券	154,426,987.60	7.52%	-	-
------	----------------	-------	---	---

注：安信证券股份有限公司为本基金本报告期新增的关联方，不涉及上年度可比期间数据。

7.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付 佣金总额的 比例
安信证券	143,817.68	7.52%	15,115.53	7.42%

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3. 安信证券股份有限公司为本基金本报告期新增的关联方，不涉及上年度可比期间数据。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,207,840.97	5,431,162.71
其中：支付销售机构的客户维护 费	593,637.25	768,134.66

注：支付基金管理人国投瑞银基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的

年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	841,568.11	1,086,232.52

注: 支付基金托管人中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
报告期初持有的基金份额	44,848,101.00	72,066,793.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总 份额	44,848,101.00	27,218,692.00
报告期末持有的基金份额	-	44,848,101.00
报告期末持有的基金份额	-	6.33%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人国投瑞银基金管理有限公司赎回本基金的交易委托国信证券办理，费率标准按照法律法规相关规定计算并支付。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	32,905,538.97	261,318.62	42,606,388.82

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-

				市						
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	配股未上市	11.06	53.21	7,755.00	85,770.30	412,643.55	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	7.35	-	-	257,600.00	1,673,945.16	1,893,360.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	93,800.00	5,317,785.24	4,881,352.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	3.91	2018-01-24	13.80	307,842.00	7,388,003.15	1,203,662.22	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响

响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 462,280,865.72 元，属于第二层次的余额为 7,298,967.30 元，属于第三层次的余额为 1,203,662.22 元(2016 年 12 月 31 日：第一层次 552,751,994.96 元，第二层次 23,631,359.35 元，无第三层次余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末, 本基金持有的第三层次金融工具公允价值为 1,203,662.22 元(2016 年 12 月 31 日: 无), 涉及 300104 乐视网(2016 年 12 月 31 日: 无)。

本会计期间净转入第三层次金额为人民币 3,443,212.77, 当期损失总额计入损益的损失金额为人民币 2,239,550.55 元, 于 2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现损失的变动—公允价值变动损失金额为人民币 6,184,340.93 元, 损失分别计入利润表中的公允价值变动损益等项目。

上述第三层次资产使用市场法作为估值技术进行估值, 以不可观察输入值为 1.25 倍市净率, 相应确定 300104 乐视网的公允价值。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

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	470,783,495.24	93.22
	其中: 股票	470,783,495.24	93.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	0.00	-
	其中: 债券	0.00	-
	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	34,155,075.07	6.76
8	其他各项资产	67,903.07	0.01
9	合计	505,006,473.38	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,844,075.20	2.35
B	采矿业	2,129,400.00	0.42
C	制造业	293,508,376.96	58.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,179,277.00	1.43
F	批发和零售业	9,560,900.81	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,188,496.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,740,963.95	6.90
J	金融业	52,600,324.37	10.45
K	房地产业	27,104,270.53	5.39
L	租赁和商务服务业	8,431,713.24	1.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069,569.03	2.00
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	9,569,008.18	1.90
S	综合	2,184,508.35	0.43
	合计	470,110,883.62	93.43

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	606,175.87	0.12
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	34,112.55	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	32,323.20	0.01
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	672,611.62	0.13

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

8.3 期末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

8.3.1 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	000333	美的集团	592,296.00	32,830,967.28	6.52
2	000651	格力电器	653,609.00	28,562,713.30	5.68
3	000725	京东方 A	3,398,076.00	19,674,860.04	3.91
4	000858	五粮液	223,340.00	17,840,399.20	3.55
5	002415	海康威视	437,424.00	17,059,536.00	3.39
6	000002	万科 A	524,894.00	16,303,207.64	3.24
7	000001	平安银行	1,178,749.00	15,677,361.70	3.12
8	300498	温氏股份	495,568.00	11,844,075.20	2.35
9	000063	中兴通讯	283,509.00	10,308,387.24	2.05
10	002304	洋河股份	84,929.00	9,766,835.00	1.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 期末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

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	002916	深南电路	3,068.00	267,621.64	0.05
2	002920	德赛西威	4,569.00	178,784.97	0.04
3	300735	光弘科技	3,764.00	54,163.96	0.01
4	002915	中欣氟材	1,085.00	38,181.15	0.01
5	300730	科创信息	821.00	34,112.55	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例 (%)
1	000001	平安银行	32,022,992.19	5.18
2	000333	美的集团	28,795,462.21	4.66
3	002142	宁波银行	28,607,107.22	4.63
4	300498	温氏股份	26,585,578.89	4.30
5	000413	东旭光电	26,104,376.00	4.22
6	000100	TCL 集团	24,239,562.50	3.92
7	000002	万 科 A	19,090,497.38	3.09
8	000776	广发证券	18,811,145.84	3.04
9	000166	申万宏源	18,683,930.68	3.02
10	002027	分众传媒	17,667,639.30	2.86
11	002008	大族激光	17,623,243.88	2.85
12	000858	五 粮 液	17,473,431.12	2.83
13	000725	京东方 A	17,155,959.00	2.78
14	000069	华侨城 A	17,140,594.74	2.77
15	002304	洋河股份	16,323,635.00	2.64
16	000783	长江证券	14,685,863.57	2.38
17	002241	歌尔股份	14,583,168.84	2.36
18	001979	招商蛇口	14,247,398.94	2.31
19	000895	双汇发展	14,234,542.70	2.30
20	002673	西部证券	13,754,788.98	2.23
21	000938	紫光股份	13,752,770.26	2.23
22	000046	泛海控股	13,734,179.45	2.22
23	300072	三聚环保	13,451,975.18	2.18
24	000402	金 融 街	13,431,777.56	2.17
25	002415	海康威视	12,430,239.75	2.01

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	35,725,430.71	5.78
2	000002	万 科 A	35,528,645.41	5.75
3	000333	美的集团	31,229,739.32	5.05
4	002142	宁波银行	31,212,992.63	5.05
5	000100	TCL 集团	28,834,375.83	4.67
6	000651	格力电器	27,647,947.25	4.47

7	000413	东旭光电	26,147,137.00	4.23
8	002027	分众传媒	25,222,556.16	4.08
9	000858	五 粮 液	22,767,816.46	3.68
10	002304	洋河股份	22,241,575.45	3.60
11	000069	华侨城 A	22,079,338.66	3.57
12	000776	广发证券	20,661,955.21	3.34
13	001979	招商蛇口	19,666,175.47	3.18
14	002008	大族激光	19,586,352.26	3.17
15	002241	歌尔股份	19,364,697.78	3.13
16	000725	京东方 A	18,857,818.00	3.05
17	000895	双汇发展	18,167,954.57	2.94
18	002252	上海莱士	16,367,440.30	2.65
19	000166	申万宏源	16,281,177.67	2.63
20	000402	金 融 街	15,832,164.03	2.56
21	000538	云南白药	15,287,581.69	2.47
22	000783	长江证券	14,880,789.00	2.41
23	000540	中天金融	13,901,019.16	2.25
24	300498	温氏股份	13,555,661.15	2.19
25	002415	海康威视	13,258,762.48	2.15
26	002736	国信证券	12,869,844.36	2.08

注："卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	920,552,288.78
卖出股票的收入（成交）总额	1,135,532,421.47

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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是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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,102.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,863.81
5	应收申购款	26,936.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,903.07

8.12.4 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处于转股期的可转债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五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	300730	科创信息	34,112.55	0.01	重大事项停牌

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
20,315	23,452.00	91,556,942.00	19.22%	384,870,445.34	80.78%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	53,395,845.00	11.51%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	29,318,994.00	6.32%
3	上海富远软件技术有限公司	5,900,000.00	1.27%
4	刘晓秋	5,500,772.00	1.19%
5	陈淮	5,400,000.00	1.16%
6	苏艳娴	2,798,972.00	0.60%
7	范艾茜	2,676,589.00	0.58%
8	李建辉	2,652,903.00	0.57%
9	冉金芬	2,648,175.00	0.57%
10	梁耀坤	2,471,891.00	0.53%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,113.65	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，本基金基金经理于本报告期末均未持有本基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 8 月 14 日)基金份额总额	3,645,807,269.28
本报告期期初基金份额总额	708,863,630.01
本报告期基金总申购份额	10,242,656.48
减：本报告期基金总赎回份额	242,678,899.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	476,427,387.34

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所已为本基金连续提供审计服务 5 年（包含本基金转型前审计服务期）。本报告期内应支付给该事务所的报酬为 110,000.00 元。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	622,592,008.08	30.32%	579,820.59	30.32%	-
华创证券	1	328,549,723.45	16.00%	305,978.34	16.00%	-
国信证券	1	257,573,512.30	12.54%	239,878.05	12.54%	-
东兴证券	1	177,856,547.69	8.66%	165,638.41	8.66%	-
申银万国	1	163,721,150.91	7.97%	152,473.25	7.97%	-
安信证券	3	154,426,987.60	7.52%	143,817.68	7.52%	-
国金证券	1	150,931,896.33	7.35%	140,563.01	7.35%	-
广发证券	1	150,541,520.25	7.33%	140,199.52	7.33%	-
东北证券	1	45,088,077.68	2.20%	41,990.83	2.20%	-
浙商证券	1	1,948,621.74	0.09%	1,814.76	0.09%	-

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本基金本报告期未发生交易所债券、回购及权证交易。

3、本基金本报告期退租德邦证券1个交易单元

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

产品特有风险

投资者应关注本基金单一投资者持有份额比例过高时,可能出现以下风险:

1、赎回申请延期办理的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要部分延期办理的风险。

2、基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;单一投资者大额赎回时,相应的赎回费归入基金资产以及赎回时的份额净值的精度问题均可能引起基金份额净值出现较大波动。

3、基金投资策略难以实现的风险

单一投资者大额赎回后,可能使基金资产净值显著降低,从而使基金在拟参与银行间市场交易等投资时受到限制,导致基金投资策略难以实现。

4、基金财产清算(或转型)的风险

根据本基金基金合同的约定,基金合同生效后的存续期内,若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。单一投资者大额赎回后,可能造成基金资产净值大幅缩减而导致本基金转换运作方式、与其他基金合并或基金合同终止等情形。

5、召开基金份额持有人大会及表决时可能存在的风险

由于单一机构投资者所持有的基金份额占比较高,在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时,单一机构投资者将拥有高的投票权重。

注:本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”),经与基金托管人协商一致,基金管理人对本基金的基金合同有关条款进行修订。本次基金合同的修订内容包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金的暂停估值和信息披露等条款,具体修订内容详见本基金于 2018 年 3 月 23 日发布的有关公告。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日

