

(上接B93版)

(二)注册登记机构  
名称:中融基金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)59378807  
联系人:崔晶

(三)律师事务所  
名称:上海市源律师事务所  
住所:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦24C  
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦24C  
负责人:刘和平  
电话:(0755)83515488  
传真:(0755)83515323  
经办律师:陈伟华、曾革文  
联系人:李秀英
(四)会计师事务所  
名称:普华永道天职国际会计师事务所(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11楼  
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路2号深业华源中心11楼  
执行事务合伙人:李丹  
联系人:施晓峰  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238800  
经办会计师:王海波、施珊珊
(五)基金销售机构  
名称:国投瑞银和深沪300指数分级证券投资基金  
五、基金的类型  
本基金为股票型基金,基金运作方式:契约型,开放式。

六、基金的基本情况

在深沪交易所上市,并远见份额的存续期内,本基金的基本份额分级及其基本运作如下。

(一)基金的份额分级

本基金的基本份额根据投资比例和资产类别将本基金分为两个子份额,简称“深沪300份额”,即瑞和康份额和瑞和远见份额。投资者在购买本基金时选择“深沪300份额”或“瑞和康份额”或“瑞和远见份额”的,其基金份额对应的收益分配政策将按照不同的子份额进行。

(二)基金的基本运作周期

本基金的运作周期为一个开放运作年度,即从基金管理人首次公告之日起至下一个开放运作年度的最后一个工作日止。

(三)基金的申购与赎回

本基金的申购与赎回方式公开透明,基金管理人应及时披露相关信息。

(四)基金的收益分配

本基金的收益分配每年至少一次。

(五)基金的风险特征

本基金属于高风险、高收益品种。

(六)基金的估值方法

在深沪交易所上市,并远见份额的存续期内,本基金的估值方法如下:

1.报告期末未基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	190,885,977.34	91.18
2	固定收益投资	190,885,977.34	91.18
3	货币市场工具	-	-
4	银行存款	-	-
5	其他资产	-	-
6	应付债券	-	-
7	应付管理人报酬	-	-
8	应付托管费	-	-
9	应付交易费用	-	-
10	应付申购款	-	-
11	其他应付款	-	-
12	预提费用	-	-
13	其他	-	-
14	合计	381,771,954.68	100.00

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	169,703.76	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	278,193.84	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	108,232.20	0.05
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、房地产	196,510.86	0.09
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	-	-
O	道路运输业	-	-
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		732,640.57	0.36

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

3.报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限股票的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流动性受限情况说明
1	000333	美的集团	3,403,402.20	1.44	重大事项停牌
2	000852	京东方A	-	-	-
3	002079	圣农发展	-	-	-
4	002157	东华能源	-	-	-
5	002188	燕京啤酒	-	-	-
6	002197	赢合科技	-	-	-
7	002238	光莆股份	-	-	-
8	002328	燕头鸭脖	-	-	-
9	002608	中炬高新	-	-	-
10	002697	西部证券	-	-	-
合计		190,133,346.77	91.61		

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资	190,885,977.34	91.18
2	固定收益投资	190,885,977.34	91.18
3	货币市场工具	-	-
4	银行存款	-	-
5	其他	-	-
6	应付债券	-	-
7	应付管理人报酬	-	-
8	应付托管费	-	-
9	应付交易费用	-	-
10	应付申购款	-	-
11	其他应付款	-	-
12	预提费用	-	-
13	其他	-	-
14	合计	381,771,954.68	100.00

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

5.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债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1000033	沪深300指数增强	190,885,977.34	91.18
2	1000003	中债-总指数	190,885,977.34	91.18
3	1000001	中债-国债指数	190,885,977.34	91.18
4	1000002	中债-企业债指数	190,885,977.34	91.18
5	1000004	中债-信用债指数	190,885,977.34	91.18

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

6.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组合

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	190,885,977.34	91.18
2	白银	190,885,977.34	91.18
3	铂金	190,885,977.34	91.18
4	钯金	190,885,977.34	91.18
5	其他	190,885,977.34	91.18

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

7.基金的证券交易费用

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	印花税	190,885,977.34	91.18
2	佣金	190,885,977.34	91.18
3	过户费	190,885,977.34	91.18
4	经手费	190,885,977.34	91.18
5	其他	190,885,977.34	91.18

注:本报告期无卖出回购金融资产的余额。

8.其他费用

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	审计费	190,885,977.34	91.18
2	评估费	190,885,977.34	91.18
3	信息披露费	190,885,977.34	91.18
4	律师费	190,885,977.34	91.18
5	印花税	190,885,977.34	91.1