

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
报告期截至日:2014年9月30日

基金管理人承诺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。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者风险,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期截至2014年7月1日至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银沪深300指数分级

基金主代码 161207

基金运作方式 约型开放式

基金合同生效日 2009年1月14日

报告期末基金份额总额 283,511,393.74份

投资目标 本基金通过被动的指数化投资管理,实现对沪深300指数的有效跟踪,力求将基金净值收益与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,跟踪误差控制在4%以内。

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权重重新构建股票组合,并根据基准指数的权重及权重的变动进行相应的调整,以复制和跟踪基准指数。

当本期指数成份股调整或成份股发生分红、配股、增发等行为时,或者特殊情况(如股票位置变化等)导致本基金无法再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,并在可操作的情况下,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%×沪深300指数收益+5%×银行同业存款利率

风险收益特征 属于高风险、高收益的基金品种,其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。

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

下属分级基金的基金简称 国投瑞银瑞和 沪深300指数

下属分级基金的交易代码 300指数(场内简称:瑞和300)(场内简称:瑞和300)

下属分级基金的份额总额 161,207 150,000

报告期末下属分级基金的份额总额 124,884,051.74份 79,483,671.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年07月01日-2014年09月30日)

1.本期已实现收益 2,267,374.83

2.本期利润 35,363,240.61

3.加权平均基金份额本期利润 0.1207

4.期末基金份额净值 285,439,511.12

5.期末基金份额净值 1.007

注:1.基金收益以人民币0.0001元为单位进行收益分配,当期收益分配的金额低于0.0001元时,舍去至零。

2.本期利润为本期收益减去本期发生的交易费用后的余额,即为可供分配给基金份额持有人的利润。

3.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

4.报告期未进行利润分配,未进行收益再分配。

5.本期基金份额净值增长率即净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较。

注:1.基金收益以人民币0.0001元为单位进行收益分配,当期收益分配的金额低于0.0001元时,舍去至零。

2.本期利润为本期收益减去本期发生的交易费用后的余额,即为可供分配给基金份额持有人的利润。

3.本基金对业绩比较基准采用每季平均的计算方法。

4.报告期未进行利润分配,未进行收益再分配。

5.本期基金份额净值增长率即净值增长率与同期业绩比较基准