

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

[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
基金管理人的董事及监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责任。
基金托管人保证复核意见不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金合同于2017年4月21日复效了本基金中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，供基金份额持有人了解基金的运作情况。
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预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金报告期财务未获审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金的基本情况

| 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 | | 296,303,666 | 0.21 |
| C 制造业 | | 40,741,049.98 | 0.03 |
| D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | | 3,264,119.28 | 0.02 |
| F 建筑业 | | 6,000,007.03 | 0.04 |
| G 交通运输业 | | 2,002,076.77 | 0.02 |
| H 饮食业和住宿业 | | 3,894,413.68 | 0.03 |
| I 信息技术业 | | 46,200.00 | 0.00 |
| J 信息技术、软件和信息技术服务业 | | 7,174,785.00 | 0.05 |
| K 金融业 | | 63,056,504.40 | 0.04 |
| L 房地产业 | | 6,411,116.70 | 0.04 |
| M 科学研究、技术服务与地质勘查业 | | 1,473,099.22 | 0.01 |
| N 水利、环境和公共设施管理业 | | 798,109.00 | 0.00 |
| O 居民服务、修理和其他服务业 | | — | — |
| P 教育 | | — | — |
| Q 卫生、文化和娱乐业 | | 133,344.03 | 0.01 |
| R 文化、体育和娱乐业 | | 2,181,326.05 | 0.07 |
| S 综合 | | 422,300.07 | 0.03 |
| 合计 | | 123,038,944.00 | 88.61 |

5.3 报告期投资组合变动情况

| 基金名称 | 报告期初基金资产净值(元) | 报告期末基金资产净值(元) |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金 | 1,27,033,043.00 | 1,27,033,043.00 |
| 国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金(A类) | 1,01,207,000.00 | 1,01,207,000.00 |
| 国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金(C类) | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |
| 国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金(E类) | 1,27,033,043.00 | 1,27,033,043.00 |

5.4 报告期投资组合变动情况

5.4.1 报告期内基金资产组合情况

5.4.2 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.3 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.4 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.5 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.6 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.7 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.8 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.9 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.10 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.11 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.12 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.13 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.14 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.15 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.16 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.17 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.18 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.19 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.20 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.21 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.22 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.23 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.24 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.25 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.26 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.27 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.28 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.29 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.30 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.31 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.32 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.33 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.34 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.35 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.36 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.37 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.38 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.39 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.40 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.41 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.42 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.43 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.44 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.45 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.46 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.47 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.48 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.49 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.50 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.51 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.52 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.53 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.54 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.55 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.56 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.57 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.58 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.59 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.60 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.61 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.62 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.63 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.64 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.65 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.66 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.67 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.68 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.69 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.70 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.71 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.72 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.73 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.74 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.75 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.76 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.77 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.78 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.79 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.80 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.81 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.82 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.83 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.84 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.85 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.86 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.87 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.88 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.89 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.90 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.91 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.92 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.93 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.94 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.95 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.96 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.97 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.98 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.99 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.100 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.101 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.102 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.103 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.104 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.105 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.106 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.107 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.108 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.109 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.110 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.111 报告期内基金投资组合的变化情况

5.4.112 报告期内基金投资组合的变化情况