国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金之瑞和小康与瑞和远见基金份额上市交易公告书

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

一、重要声明与提示

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金之瑞和小康与瑞和远见基金份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金之瑞和小康与瑞和远见基金份额上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2009年9月14日刊登于《上海证券报》和国投瑞银基金管理有限公司网站（www.ubssdic.com）的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金名称：国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额包括国投瑞银瑞和沪深300指数证券投资基金之基础份额（简称“瑞和300”）、国投瑞银瑞和沪深300指数证券投资基金之小康份额（简称“瑞和小康”）与国投瑞银瑞和沪深300指数证券投资基金之远见份额（简称“瑞和远见”）。其中，瑞和小康、瑞和远见的基金份额配比始终保持1：1的比率不变。

5、本基金的存续期限为不定期。其中，瑞和小康与瑞和远见自《基金合同》生效之日起按运作周年滚动存续。

6、瑞和300的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对瑞和300份额进行申购与赎回。瑞和300场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。瑞和300场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。瑞和小康与瑞和远见将不接受投资者的申购与赎回。

7、份额配对转换：份额配对转换是指瑞和300与瑞和小康、瑞和远见之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的每两份瑞和300的场内份额申请转换成一份瑞和小康与一份瑞和远见；合并是指基金份额持有人将其持有的每一份瑞和小康与一份瑞和远见配对申请转换成两份瑞和300的场内份额。份额配对转换自本基金上市交易后不超过6个月的时间内开始办理，有关份额配对转换的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

8、在瑞和小康、瑞和远见存续期内的每一个运作周年的最后一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金所有份额进行基金份额折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为1.000元。其中，如果瑞和300折算前的基金份额净值大于1.000元，基金份额折算后，基金份额持有人持有的瑞和300的份额数按照折算比例相应增加，瑞和小康、瑞和远见各自的新增份额将全部折算成基金份额持有人持有的瑞和300的场内份额；如果瑞和300折算前的基金份额净值小于或等于1.000元，基金份额折算后，基金份额持有人持有的瑞和300、瑞和小康、瑞和远见各自的份额数按折算比例相应缩减。

9、经基金份额持有人大会决议通过，瑞和小康与瑞和远见可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的瑞和300、瑞和小康与瑞和远见各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

10、基金份额总额：截至2009年11月12日，本基金的基金份额总额为3,215,923,206.99份，其中，瑞和300为257,188,522.99份，瑞和小康为1,479,367,342份，瑞和远见为1,479,367,342份。

11、基金份额净值：截止2009年11月12日，瑞和300的基金份额净值为1.040元，瑞和小康的基金份额净值为1.064元，瑞和远见的基金份额净值为1.016。

12、本次上市交易的基金份额简称：瑞和小康、瑞和远见

13、本次上市交易的基金份额总额：瑞和小康1,479,367,342份；瑞和远见1,479,367,342份

14、本次上市交易的基金份额交易代码：瑞和小康为150008；瑞和远见为150009

15、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

16、上市交易日期：2009年11月19日

17、基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

18、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

19、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

20、在本基金募集发售期间，本基金在深圳证券交易所的发售代码为161207，简称为“瑞和分级”。因瑞和300基金份额开放申购赎回业务的需要，经本公司申请并经深圳证券交易所审批，将深圳证券交易所代码“161207”变更为瑞和300的基金代码，并将其对应简称由“瑞和分级”变更为“瑞和300”。

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：经2009年8月28日中国证监会证监许可[2009]865号文批准募集

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2009年9月17日至2009年9月30日

5、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

6、认购费率

本基金的认购费率按认购金额分档设置，最高不超过1%。其中，采用场内认购方式认购本基金的，比照执行场外认购费率。

7、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所

8、募集资金总额及入账情况

本基金募集的总净缴存金额（不含手续费）人民币3,215,075,553.30元，确认份额（不含利息转份额）3,215,075,553.30份，利息结转份额847,653.69份，总确认份额为3,215,923,206.99份。

上述总净缴存金额已于2009年10月14日分别划入本基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的托管专户。

根据《基金合同》的约定，本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额确认为瑞和300份额；场内认购的全部份额按1：1的比率确认为瑞和小康份额和瑞和远见份额。按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间募集及利息结转的基金份额共计3,215,923,206.99份，其中场外认购的基金份额确认为257,188,522.99份瑞和300；场内认购的基金份额按1：1的比率确认为1,479,367,342份瑞和小康和1,479,367,342份瑞和远见。

9、基金案情况

本基金已于2009年10月14日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2009年10月14日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

10、基金合同生效日：2009年10月14日

11、基金合同生效日的基金份额总额：3,215,923,206.99份，其中，瑞和300为257,188,522.99份，瑞和小康为1,479,367,342份，瑞和远见为1,479,367,342份

（二）瑞和小康与瑞和远见上市交易的主要内容

1、本基金的瑞和小康与瑞和远见上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2009】150号

2、上市交易日期：2009年11月19日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：瑞和小康、瑞和远见

5、交易代码：瑞和小康为150008、瑞和远见为150009

6、本次上市交易份额：瑞和小康为1,479,367,342份、瑞和远见为1,479,367,342份

7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布该工作日的瑞和300、瑞和小康与瑞和远见的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）基金份额持有情况

截至2009年11月12日，基金份额持有人户数：19,234户，平均每户持有的基金份额为167,199.92份，其中，瑞和300为4,654户，平均每户持有的基金份额为55,261.82份；瑞和小康为14,580户，平均每户持有的基金份额为101,465.52份；瑞和远见为14,580户，平均每户持有的基金份额为101,465.52份。

机构投资者持有的本次上市交易的瑞和小康与瑞和远见的基金份额分别为960,912,665份，分别占本次瑞和小康与瑞和远见上市交易基金份额比例为64.9543%；个人投资者持有的本次上市交易的瑞和小康与瑞和远见的基金份额分别为518,454,677份，分别占本次瑞和小康与瑞和远见上市交易基金份额比例为35.0457%。

（二）基金份额前十名持有人情况

本次上市交易的瑞和小康与瑞和远见前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有瑞和小康份额	占瑞和小康份额比	持有瑞和远见份额	占瑞和远见份额比
1	中国人寿保险股份有限公司	200,059,000	13.52	200,059,000	13.52
2	生命人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	100,053,500	6.76	100,053,500	6.76
3	中国人寿保险（集团）公司	50,014,500	3.38	50,014,500	3.38
4	西南证券股份有限公司	50,013,000	3.38	50,013,000	3.38
5	海通证券股份有限公司	40,002,000	2.70	40,002,000	2.70
6	新华人寿保险股份有限公司	30,015,700	2.03	30,015,700	2.03
7	中国平安人寿保险股份有限公司－万能－个险万能	30,008,400	2.03	30,008,400	2.03
8	中融国际信托有限公司－双重精选1号	25,012,999	1.69	25,012,999	1.69
9	太平人寿保险有限公司－传统－普通保险产品－022L－CT001深	25,007,000	1.69	25,007,000	1.69
10	太平人寿保险有限责任公司－万能－团险万能	25,007,000	1.69	25,007,000	1.69

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：国投瑞银基金管理有限公司

2、注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

3、法定代表人：钱蒙

4、总经理：尚健

5、成立时间：2002年6月13日

6、注册资本：壹亿元人民币

7、设立批准文号：中国证监会证监基字[2002]25号

8、工商登记注册的法人营业执照文号：企合粤深总字第111037号

9、经营范围：基金管理业务；设立与发起基金；特定客户资产管理；境外证券投资管理及经中国证券监督管理委员会批准的其他业务

10、存续期间：持续经营

11、股东及其出资比例：国投信托有限公司(51%)、瑞士银行股份有限公司（UBS AG）(49%)

12、内部组织结构及职能

本基金管理人内部共设有研究部、基金投资部、专户投资部、交易部、运营部、信息技术部、渠道服务部、机构服务部、市场服务部、产品及业务拓展部、监察稽核部、总经理办公室共十二个职能部门，并在北京、上海设立有分公司。

研究部：公司的研究支持部门，为基金及其他受托资产投资提供决策依据；

基金投资部：基金的投资决策部门；

专户投资部：负责基金除外的其他受托产品的投资决策部门；

交易部：公司投资交易的执行部门；

运营部：是公司受托资产会计、清算及注册登记的职能部门；

信息技术部：为公司正常运转提供信息系统支持及信息安全保障的职能部门；

渠道服务部：建立维护和管理主代销银行和券商关系的职能部门；

机构服务部：负责公司机构直销业务及客户开发、管理的职能部门；

产品及业务拓展部：负责产品开发和新业务拓展的职能部门；

市场服务部：负责市场策划、销售支持、客户服务及管理的职能部门；

监察稽核部：负责公司法务、合规管理、投资风控和内部审计的职能部门；

总经理办公室：负责人事管理、财务管理及日常行政事务，下设人力资源室、财务室和综合服务中心；

异地分支机构：建立和维护辖区代销机构的合作关系，开发和管理辖区销售渠道、机构和个人客户，负责辖区基金及其他受托产品销售工作。

13、人员情况

截至2009年9月30日，公司共有员工123人，所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

14、信息披露负责人及咨询电话：包爱丽，(0755)83575988

15、基金管理业务情况

截至2009年9月30日，国投瑞银基金管理有限公司旗下共管理1只创新型基金和8只开放式基金，管理的基金总资产超过270亿元。旗下管理的创新型基金为国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金，开放式基金分别为国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银核心企业股票型证券投资基金、国投瑞银成长优选股票型证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金、国投瑞银稳健增长灵活配置混合型证券投资基金和国投瑞银货币市场基金。此外，本基金基金合同于2009年10月14日生效，实际募集规模为32.16亿元。

16、本基金基金经理

路荣强，澳大利亚籍，澳大利亚新南威尔士大学基金管理专业硕士，9年证券从业经验。曾先后任职于美世投资管理顾问公司（Mercer Investment Consulting）担任投资分析师，负责为大型机构客户如主权基金、养老金等提供投资咨询业务，从事全球基金研究、外汇对冲及投资量化方面的工作；澳大利亚联邦基金管理有限公司(Commonwealth Investment Management)，担任投资量化及绩效分析师，负责投资量化、风险测算及绩效分析方面的工作；澳大利亚康联首域投资基金管理公司（Colonial First State Investments），历任投资分析师、投资经理，先后管理平衡型基金、战略资产配置决策、量化投资管理、FoF、基金平台及一个对冲基金，负责REIT行业研究；2008年2月加入国投瑞银基金管理有限公司，现任部门负责人及高级投资经理，负责国际投资及量化投资投研工作。

（二）基金托管人

1、名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称：中国工商银行）

2、注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

3、法定代表人：姜建清

4、成立时间：1984年1月1日

5、注册资本：叁仟叁拾肆拾亿壹仟捌佰捌拾伍万零贰拾陆元人民币

6、托管部门负责人：周月秋

7、信息披露负责人：蒋松云

8、咨询联系电话：(010)66105799

9、主要人员情况

截至2009年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工117人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

10、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。

截至2009年6月，托管证券投资基金127只，其中封闭式8只，开放式119只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初，中国工商银行先后被《环球金融》、《全球托管人》、《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》及《证券时报》评选为2008年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得18项国内外大奖。

（三）基金验资机构

1、名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

2、注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

3、办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

4、法人代表：杨绍信

5、经办注册会计师：薛竞、金毅

6、联系电话：(021)23238888

六、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金的基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

本基金除瑞和小康份额与瑞和远见份额的基金份额净值计算、基金份额折算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、终止瑞和小康份额与瑞和远见份额运作后的份额转换外，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果瑞和小康份额与瑞和远见份额的运作出现终止，则在终止瑞和小康份额与瑞和远见份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）按照《基金合同》的规定，分享基金财产收益；

（2）按照《基金合同》的规定，参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依照法律法规及《基金合同》的规定，依法转让其持有的瑞和小康份额与瑞和远见份额，依法申请赎回其持有的瑞和300份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）遵守《基金合同》；

（2）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（3）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

（6）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

2、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集基金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应星报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理瑞和300份额的申购与赎回申请；

（12）在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整相关业务规则，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

（13）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（14）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（15）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（16）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应星报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，瑞和300份额、瑞和小康份额与瑞和远见份额的基金份额净值，基金份额折算比例，瑞和小康份额与瑞和远见份额终止运作后的份额转换比例；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制半年度和年度基金报告；

（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理瑞和300份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（24）基金在募集期间未能达到备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应星报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值，瑞和300份额、瑞和小康份额与瑞和远见份额的基金份额净值，基金份额折算比例，瑞和小康份额与瑞和远见份额终止运作后的份额转换比例；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（15）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由瑞和300份额、瑞和小康份额与瑞和远见份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

1、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）终止瑞和小康份额与瑞和远见份额的运作；

（9）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（10）变更基金份额持有人大会程序；

（11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（12）单独或合计持有瑞和300份额、瑞和小康份额与瑞和远见份额各自基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整瑞和300份额的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起2日内在至少一家指定媒体公告。

2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（4）基金财产清算程序：

①《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

②对基金财产和债权债务进行清理和确认；

③对基金财产进行估值和变现；

④制作清算报告；

⑤聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

⑥将清算报告报中国证监会备案并公告；

⑦对基金财产进行分配。

（5）基金财产清算的期限为6个月。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算瑞和300份额、瑞和小康份额与瑞和远见份额各自的应计分配比例，并据此由瑞和300份额、瑞和小康份额与瑞和远见份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的瑞和小康份额与瑞和远见份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

（八）争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费用收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金截止2009年11月12日资产负债表（未经审计）如下：

国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金

2009年11月12日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

2009年11月12日	
资产	
银行存款	141,596,862.63
结算备付金	27,107,580.74
存出保证金	—
交易性金融资产	3,175,925,374.11
其中：股票投资	3,175,925,374.11
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	1,126,378.50
应收利息	971,298.68
应收股利	—
应收申购款	378,190.69
其他资产	—
资产总计	3,347,105,685.35
负债及所有者权益	
负债	
应付证券清算款	—
应付管理人报酬	1,083,722.35
应付托管费	238,418.91
应付交易费用	2,556,778.17
应付税费	—
应付赎回款	—
其他负债	—
负债合计	3,923,349.73
所有者权益	
实收基金	3,215,923,206.99
未分配利润	127,259,128.63
所有者权益合计	3,343,182,335.62
负债及所有者权益总计	3,347,105,685.35

（2009年11月12日基金份额净值1.040元）

八、基金投资组合

截止到2009年11月12日，国投瑞银瑞和沪深300指数分级证券投资基金的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
股票	3,175,925,374.11	94.89
债券	—	–
权证	—	–
银行存款及清算备付金	168,704,443.37	5.04
其他资产	2,475,867.87	0.07
合计	3,347,105,685.35	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允市值（元）	占基金资产净值比例（%）
A农、林、牧、渔业	13,266,744.00	0.40
B采掘业	372,120,775.08	11.13
C制造业	951,668,670.70	28.47
C0食品、饮料	118,878,968.40	3.56
C1纺织、服装、皮毛	17,401,423.83	0.52
C2木材、家具	–	–
C3造纸、印刷	12,673,488.81	0.38
C4石油、化学、塑胶、塑料	86,740,453.26	2.59
C5电子	14,443,026.34	0.43
C6金属、非金属	301,376,024.22	9.01
C7机械、设备、仪表	294,394,181.85	8.81
C8医药、生物制品	86,410,135.71	2.58
C99其他制造业	19,350,968.28	0.58
D电力、煤气及水的生产和供应业	87,111,562.73	2.61
E建筑业	66,268,529.30	1.98
F交通运输、仓储业	151,311,243.76	4.53
G信息技术业	91,173,543.83	2.73
H批发和零售贸易	99,346,716.10	2.97
I金融、保险业	1,021,644,099.42	30.56
J房地产业	202,385,830.41	6.05
K社会服务业	44,164,374.54	1.32
L传播与文化产业	8,820,164.12	0.26
M综合类	66,643,120.12	1.99
合计	3,175,925,374.11	95.00

（三）报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	6,671,523	120,754,566.30	3.