

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
送出日期:2014年03月31日

1.1 重要提示
基金管理人承诺:保证基金资产不存在虚假记载、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在法定的范围内连带责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)
基金代码:161217
交易场所:深圳证券交易所

投资目标:本基金通过被动指数化投资管理,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年度跟踪误差控制在不超过0.35%以内,年化跟踪误差控制在不超过0.45%以内。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称: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

3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标
本期期末余额:18,356,278.98
本期期末基金份额净值:1.0617

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率差, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月, 过去六个月, 自基金合同生效起至今.

注:1.本基金采用现金流量法计算利息收入、投资收益、其他收入,在公允价值估值扣除除相关费用后的余额,本期利润为本基金已实现收益加本期公允价值变动收益。

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:过去三个月, 过去六个月, 自基金合同生效起至今.

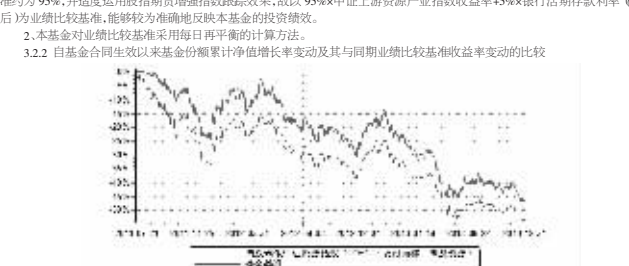


图 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

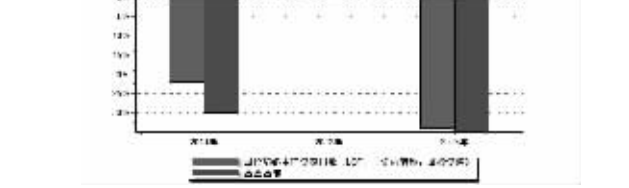


图 3.2.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2011年7月21日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不整年自然年度进行折算。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司

4.1.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况
姓名:刘伟
职务:本基金基金经理
任职日期:2011年07月21日

4.2 基金管理人内部控制制度
4.2.1 基金管理人内部控制制度的概述
基金管理人内部控制制度包括:投资管理、风险管理、法律合规、信息技术、运营、财务、人力资源、行政、纪检监察等。

4.2.2 基金管理人内部控制制度的执行情况
基金管理人内部控制制度执行情况良好,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.2.3 基金管理人内部控制制度的完善情况
基金管理人将根据法律法规和监管要求,不断完善内部控制制度,提高基金管理的科学性和规范性。

4.2.4 基金管理人内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.2.5 基金管理人内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.2.6 基金管理人内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.2.7 基金管理人内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

2013 年度 报告摘要

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为:中证上游资源产业指数成份股及其备选成份股、新股、债券、货币、股指期货及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年,在国内经济持续放缓、国内经济增速逐步回落的背景下,A股市场整体呈现震荡下行态势,上证指数全年下跌13.41%,沪深300指数下跌10.26%,创业板指数下跌20.26%。

4.2 报告期内基金业绩表现
截至报告期末,本基金基金份额净值为1.0617元,2013年度净值增长率为-34.11%,同期业绩比较基准收益率为-34.77%,基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的年度跟踪误差为0.066%,年化跟踪误差为1.51%。

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司

4.3.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况
姓名:刘伟
职务:本基金基金经理
任职日期:2011年07月21日

4.3.3 基金管理人及基金托管人的内部控制制度
基金管理人内部控制制度包括:投资管理、风险管理、法律合规、信息技术、运营、财务、人力资源、行政、纪检监察等。

4.3.4 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的执行情况
基金管理人内部控制制度执行情况良好,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.5 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的完善情况
基金管理人将根据法律法规和监管要求,不断完善内部控制制度,提高基金管理的科学性和规范性。

4.3.6 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.7 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.8 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.9 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.10 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.11 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.12 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.13 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.14 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.15 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.16 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.17 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.18 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.19 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的合规性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.3.20 基金管理人及基金托管人的内部控制制度的有效性
基金管理人内部控制制度符合法律法规和监管要求,能够有效防范和化解风险,保障基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.

注:1.买入股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。
2.卖出股票成本及成交金额:成交金额乘以成交数量,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 601088, 600026, 600028, etc.