

## 工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金(LOF)

### 2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司  
基金托管人:中国民生银行  
报告送出日期:二〇一四年七月十七日

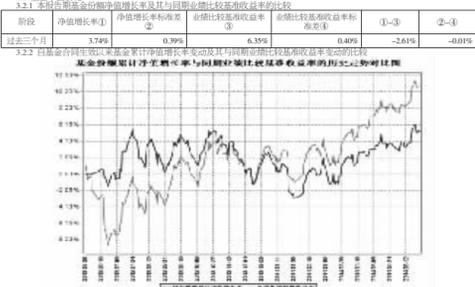
**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。  
基金的投资业绩并不表示对未来业绩表现的预测,投资者不应据此做出投资决策,投资者自行承担投资风险。  
本报告所载资料截止至2014年6月30日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	工银瑞信标普全球自然资源指数(QDII-LOF)人民币份额
交易代码	160819
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月28日
报告期末基金份额总额	2,313,789,821
投资目标	跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制策略,跟踪标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合,并跟踪标的指数的净值及权重的变动进行相应调整,力争使跟踪偏离度和跟踪误差控制在0.5%以内,跟踪误差小于0.4%。
业绩比较基准	95%人民币市价的标普全球自然资源指数收益率+5%人民币市价国债收益率(税后)
风险收益特征	本基金为投资于全球自然资源和大宗商品生产、运输和加工环节的跟踪标的指数基金,属于中高风险的基金品种,其预期收益及风险水平高于国内普通股票型基金及混合型基金,相关《招募说明书》中基金风险等级为中高风险。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**2.1 主要财务指标和基金净值表现**

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	118,601.94
2.本期利润	126,661.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094
4.期末基金份额净值	2,436,434.88
5.期末基金资产净值	1,083



**3.1 主要财务指标** 单位:人民币元  
注:1.本基金基金合同于2013年5月28日生效。  
2.本报告期末,本基金资产净值中,扣除基金管理费、托管费、销售服务费、利息支出、应付税费及应付赎回款项后的余额,即为可供分配的利润。  
3.本报告期末,本基金资产净值中,扣除基金管理费、托管费、销售服务费、利息支出、应付税费及应付赎回款项后的余额,即为可供分配的利润。  
4.本报告期末,本基金资产净值中,扣除基金管理费、托管费、销售服务费、利息支出、应付税费及应付赎回款项后的余额,即为可供分配的利润。

**3.2 本报告期末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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.74%	0.39%	6.35%	0.49%	-2.61%	-0.01%



**3.3 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较**

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三年	3.74%	0.39%	6.35%	0.49%	-2.61%	-0.01%

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
魏晓	2013年5月28日	6	2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部基金经理,2010年10月18日至2013年5月28日任工银瑞信标普全球自然资源指数(QDII-LOF)人民币基金份额基金经理,2012年10月18日至2013年5月28日任工银瑞信标普全球自然资源指数(QDII-LOF)人民币基金份额基金经理,2013年5月28日至今任工银瑞信标普全球自然资源指数(QDII-LOF)人民币基金份额基金经理。

**4.2 报告期内基金经理变动情况说明**  
报告期内,本基金管理人魏晓(证券从业资格)等有关法律法规及基金合同、招募说明书等基金文件的规定,依照法律法规、基金合同及招募说明书的约定,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,认真履行基金份额持有人的受托义务。  
**4.3 公募基金投资决策程序**  
本基金管理人魏晓(证券从业资格)等有关法律法规及基金合同、招募说明书等基金文件的规定,依照法律法规、基金合同及招募说明书的约定,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,认真履行基金份额持有人的受托义务。

**4.3 报告期内基金投资资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,304,828.07	78.64
2	固定收益	2,075,009.21	70.40
3	银行存款	161,238.81	5.50
4	其他资产	68,458.08	2.28

**4.4 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.5 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.6 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.7 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.8 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.9 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.10 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.11 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.12 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.13 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.14 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.15 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.16 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.17 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.18 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.19 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.20 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.21 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.22 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.23 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.24 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.25 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.26 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.27 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.28 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.29 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.30 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.31 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.32 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.33 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.34 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.35 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.36 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.37 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.38 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.39 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.40 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.41 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.42 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.43 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.69	0.01

**4.44 基金资产组合情况**

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	162.69	0.01
2	固定收益	162.69	0.01
3	银行存款	162.69	0.01
4	其他资产	162.6	