

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08月29日

1.1 重要提示
基金管理人承诺: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于2014年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值数据、申购赎回数据、财务指标等,保证其中内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2.1 基金基本情况
国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)
基金代码:161213
基金运作方式:上市型契约式开放式
基金合同生效日:2010年12月16日

2.2 基金产品说明
本基金通过被动跟踪中证下游消费与服务产业指数,实现对中证下游消费与服务产业指数的跟踪,即跟踪指数的成份股及其权重和基金投资组合,并根据指数的成份股及其权重进行相应的调整,以期保持基金投资组合与指数的跟踪误差,本基金在严格控制跟踪误差的前提下,以期获得优于指数的投资业绩。

2.3 基金管理人及基金托管人
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
基金管理人地址:深圳市福田区益田路4028号国投大厦14层
基金托管人地址:中国工商银行总行

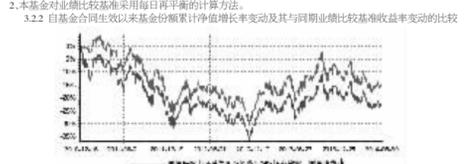
2.4 信息披露方式
基金年度报告正文的网址:www.ubsic.com.cn
基金半年度报告备查地点:深圳市福田区益田路4028号国投大厦14层

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
报告期:2014年01月01日至2014年06月30日
本期已实现收益: -139,231.63
本期利润: -12,069,107.68

3.1.2 期末数据和指标
报告期末(2014年06月30日)
期末可供分配基金份额总额: 4,487.00
期末基金份额净值: 214,853.3301
期末基金资产净值: 8,859.00

3.2 主要财务指标和基金净值表现
3.2.1 主要财务指标
报告期:2014年01月01日至2014年06月30日
本期已实现收益: -139,231.63
本期利润: -12,069,107.68
加权平均基金份额本期利润: -0.0459
本基金份额净值增长率: -0.89%

3.2.2 基金自基金成立以来的基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓结束,本基金各资产类别资产配置比例及披露说明书有关投资比例的约定。



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓结束,本基金各资产类别资产配置比例及披露说明书有关投资比例的约定。

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
国投瑞银基金管理有限公司(简称“公司”),原中融基金管理有限公司,经中国证监会核准,于2002年6月13日正式成立,注册资本1亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司。

4.1.2 基金基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介
姓名: 魏奕
职务: 本基金基金经理
任职日期: 2012年10月09日
离任日期: 2014年04月25日
证券从业年限: 9

4.1.3 基金基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介
姓名: 魏奕
职务: 本基金基金经理
任职日期: 2012年10月09日
离任日期: 2014年04月25日
证券从业年限: 9

4.1.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2014年上半年,整体消费类基金表现相对平稳。一季度,受春节及市场环境等因素影响,基金在板块间的流动导致一季度整体资产配置表现较好。二季度,传统的纺织服装、食品饮料、商贸零售、交通运输板块表现较好,而表现相对较弱的计算机、传媒等板块表现相对较差。从不断有政策出台的供给侧来看,板块表现较为活跃。上半年该板块成为涨幅最大的板块,整体来看,下游消费板块上半年以震荡为主,涨幅在300指数的表现。

4.1.5 报告期内基金业绩比较基准的专项说明
4.1.5.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,管理通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现,确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对交易行为的实时监控、分析评估信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效地公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到较好地贯彻执行,未发现有在公平交易原则的现。

4.1.5.2 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。
基金管理人管理的有投资组合内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交或交易所大宗交易超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.1.5.3 基金管理人投资的投资策略和业绩表现说明
2014年上半年,整体消费类基金表现相对平稳。一季度,受春节及市场环境等因素影响,基金在板块间的流动导致一季度整体资产配置表现较好。二季度,传统的纺织服装、食品饮料、商贸零售、交通运输板块表现较好,而表现相对较弱的计算机、传媒等板块表现相对较差。从不断有政策出台的供给侧来看,板块表现较为活跃。上半年该板块成为涨幅最大的板块,整体来看,下游消费板块上半年以震荡为主,涨幅在300指数的表现。

4.1.5.4 报告期内基金业绩比较基准的专项说明
4.1.5.4.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,管理通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现,确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对交易行为的实时监控、分析评估信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效地公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到较好地贯彻执行,未发现有在公平交易原则的现。

4.1.5.5 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。
基金管理人管理的有投资组合内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交或交易所大宗交易超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.1.5.6 基金管理人投资的投资策略和业绩表现说明
2014年上半年,整体消费类基金表现相对平稳。一季度,受春节及市场环境等因素影响,基金在板块间的流动导致一季度整体资产配置表现较好。二季度,传统的纺织服装、食品饮料、商贸零售、交通运输板块表现较好,而表现相对较弱的计算机、传媒等板块表现相对较差。从不断有政策出台的供给侧来看,板块表现较为活跃。上半年该板块成为涨幅最大的板块,整体来看,下游消费板块上半年以震荡为主,涨幅在300指数的表现。

国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

6.1 资产负债表
单位:人民币元
资产: 11,339,176.91
负债和所有者权益: 215,472,822.94

Table with columns: 资产, 附注号, 期末, 上期期末. Rows include 货币资金, 银行存款, 交易性金融资产, 应收利息, 其他流动资产, 其他资产, 应付利息, 应付债券, 其他流动负债, 其他负债, 其他所有者权益.

Table with columns: 负债和所有者权益, 附注号, 期末, 上期期末. Rows include 短期借款, 交易性金融负债, 应付利息, 应付债券, 其他流动负债, 其他负债, 其他所有者权益.

6.2 利润表
单位:人民币元
项目: 一、收入, 利息收入, 其他收入, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出.

Table with columns: 项目, 期末, 上期期末. Rows include 一、收入, 利息收入, 其他收入, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出.

Table with columns: 项目, 期末, 上期期末. Rows include 一、收入, 利息收入, 其他收入, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出.

Table with columns: 项目, 期末, 上期期末. Rows include 一、收入, 利息收入, 其他收入, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出, 公允价值变动收益, 其他收益, 其他业务收入, 其他业务支出.

6.4 本报告期主要会计政策和会计估计与上一会计期间保持一致。
6.4.1 基金基本情况
国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)以下简称“本基金”经中国证监会核准,于2010年12月16日正式成立,注册地为广东省深圳市,基金类型为契约式开放式,基金规模为人民币100亿元。

6.4.2 基金业绩比较基准的编制说明
本基金业绩比较基准按照财政部于2006年1月18日颁布的《企业会计准则》和《证券投资基金会计核算业务指引》编制,其后的会计准则修订以及中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。

6.4.3 基金业绩比较基准的编制说明
本基金业绩比较基准按照财政部于2006年1月18日颁布的《企业会计准则》和《证券投资基金会计核算业务指引》编制,其后的会计准则修订以及中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。

6.4.4 本报告期主要会计政策和会计估计与上一会计期间保持一致。
6.4.4.1 基金基本情况
国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金(LOF)以下简称“本基金”经中国证监会核准,于2010年12月16日正式成立,注册地为广东省深圳市,基金类型为契约式开放式,基金规模为人民币100亿元。

6.4.4.2 基金业绩比较基准的编制说明
本基金业绩比较基准按照财政部于2006年1月18日颁布的《企业会计准则》和《证券投资基金会计核算业务指引》编制,其后的会计准则修订以及中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易。
6.4.8.2 关联方交易
6.4.8.2.1 基金管理人
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的资产管理费, 基金托管费, 基金销售服务费, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.60%/当年天数.

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 基金托管费, 基金销售服务费, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.13%/当年费率计提, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.13%/当年费率计提.

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 基金托管费, 基金销售服务费, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.13%/当年费率计提, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.13%/当年费率计提.

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 基金托管费, 基金销售服务费, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.13%/当年费率计提, 基金管理人报酬-前一交易日基金资产净值x0.13%/当年费率计提.

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末估值单价, 复牌日期, 复牌开盘价, 数量, 期末成本总额, 期末公允价值. Rows include 002252 上海医药, 002478 汉国医药, 600370 贝因美, 600170 钱江摩托, 600637 百视通, 600832 东方明珠.

7.1 期末基金资产组合情况
7.1.1 权益投资
7.1.2 报告期末(按投资行业分类)的股票投资组合
7.1.3 报告期末(按投资行业分类)的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include A 农林、牧、渔业, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息传输、软件和信息技术服务业, J 金融业, K 房地产业, L 租赁和商务服务业, M 科学研究和技术服务业, N 水利、环境和公共设施管理业, O 批发和零售业, P 教育, Q 卫生、社会保障和福利业, R 文化、体育和娱乐业, S 综合.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

Table with columns: 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(%). Rows include 1 000651 格力电器, 2 600519 贵州茅台, 3 600887 伊泰股份, 4 600104 上汽集团, 5 601006 大秦铁路, 6 600888 五矿钢铁, 7 600333 美罗药业, 8 600234 罗普斯铝, 9 600590 中研股份, 10 600538 云南白药, 11 000268 万丰照明.

注:“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
注:“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元

Table with 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 1 000651 格力电器, 2 000100 TCL 集团, 3 600594 锦化药业, 4 600717 天普股份, 5 600887 伊泰股份, 6 600519 贵州茅台, 7 002001 新和成, 8 600900 青岛海尔, 9 600637 百视通, 10 600104 上汽集团, 11 600872 康美药业, 12 601006 大秦铁路, 13 002570 贝因美, 14 600998 \*ST大荒, 15 002299 圣农发展, 16 000423 东阿阿胶, 17 002024 苏宁云商, 18 000888 五矿钢铁, 19 000538 云南白药, 20 002268 万丰照明.

注:“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
金额单位:人民币元

Table with columns: 买入股票的成本/成交总额, 卖出股票的收入/成交总额. Rows include 买入股票的成本/成交总额: 22,811,935.42; 卖出股票的收入/成交总额: 44,088,913.48.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 可转债, 7 其他, 合计.

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 110022 国债逆回购, 10, 1,143.80, 0.00.

7.7 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 110022 国债逆回购, 10, 1,143.80, 0.00.

7.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
7.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
7.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
7.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12.1 基金投资组合前十名证券的发行主体本期曾受到公开谴责、处罚的情况
7.12.2 基金投资组合前十名证券的发行主体本期曾受到公开谴责、处罚的情况
7.12.3 基金投资组合前十名证券的发行主体本期曾受到公开谴责、处罚的情况

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 110022 国债逆回购, 1,143.80, 0.00.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 合计.

注:1.本基金管理人担任证券登记结算机构,符合中国证监会的有关规定,本基金管理人担任证券登记结算机构的注册水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯及数据条件作为基金专用交易系统的选择标准,由新设、控股及交易与券商进行并明确提出交易专用系统,明确及权证交易。
2.本基金本报告期租用交易单元未发生变更。
国投瑞银基金管理有限公司
二〇一四年八月二十九日