

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:2016年3月28日

1.1 重要提示
基金管理人承诺,基金财产的投资不受不稳定性市场波动的影响,并承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,为基金份额持有人的利益,恪尽职守,履行义务,维护基金份额持有人的合法权益。

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:160217
基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金通过投资于国内证券市场,跟踪标的指数表现,力求取得与标的指数相一致的长期投资回报,追求基金资产的长期增值。
投资策略:本基金主要采用完全复制法,跟踪标的指数的表现。

2.3 基金管理人、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

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文披露网址:www.ubscdc.com
基金年度报告全文披露日期:2016年4月20日

3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 基金净值表现
3.3 基金业绩比较基准
3.4 基金费用

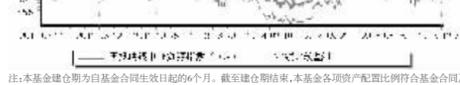
Table with 4 columns: 项目, 2015年, 2014年, 2013年. Rows include 本期基金份额净值增长率, 本期基金份额净值增长率标准差, etc.

注:1、本基金采用收益法计提基金本期利息收入、投资收益及其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润已实现部分的孰低数(为负数,不取孰低数)。

注:1、本基金业绩比较基准为中证上游资源产业指数收益率,中证上游资源产业指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后)。
2、本基金对业绩比较基准采用日再平衡的计算方法。

Table with 2 columns: 年份, 业绩比较基准. Rows include 2013年, 2014年, 2015年.

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例约定。



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,不按整个自然年度进行折算。

4.1 基金管理人及基金情况
4.1.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日
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
投资目标:本基金通过投资于国内证券市场,跟踪标的指数表现,力求取得与标的指数相一致的长期投资回报,追求基金资产的长期增值。

4.1 基金管理人及基金情况
4.1.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规(《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》)等有关规范,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽责的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。

4.3 公平交易制度和内部控制
基金管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制定了公平交易管理相关的《公平交易管理制度》、《交易管理办法》、《异常交易管理制度》等系列制度,并建立了完善的控制措施和业务流程。

4.4 基金管理人及基金情况
4.4.1 基金管理人的介绍
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。

注:自即日起和任期内均由公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的合法定义参照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
8.4 报告期内未持有积极投资股票。
8.4.1 报告期内未持有积极投资股票。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末资产占基金资产净值比例, 占期末基金资产净值比例.

注:“买入金额”按买入成交金额(或申购价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末资产占基金资产净值比例, 占期末基金资产净值比例.

注:“买入金额”按买入成交金额(或申购价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3 期末持有股票市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末资产占基金资产净值比例, 占期末基金资产净值比例.

注:“买入金额”按买入成交金额(或申购价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.4 报告期内未持有积极投资股票。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末资产占基金资产净值比例, 占期末基金资产净值比例.

注:“买入金额”按买入成交金额(或申购价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.5 报告期内未持有积极投资股票。

8.6 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
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
8.8 期末未持有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

8.9 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
8.10 报告期内未持有股票投资

8.10.1 报告期内未持有股票投资
8.10.2 本基金投资期间未进行股票投资

8.11 报告期内未持有股票投资
8.11.1 本期报告期内未持有股票投资

8.12 本基金投资期间未进行股票投资
8.12.1 本基金投资期间未进行股票投资

8.12.2 本基金投资期间未进行股票投资
8.12.3 本基金投资期间未进行股票投资

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户数(户), 机构投资者持有基金份额, 机构投资者持有基金份额占基金份额总额的比例, 个人投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额占基金份额总额的比例.

注:以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。
9.2 期末上市基金份额前十名持有人

Table with 5 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例.

注:以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。
9.3 期末基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

Table with 4 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例.

§10 开放式基金份额变动
基金合同生效以来基金份额变动情况如下:
基金合同生效以来基金份额变动情况如下:

11.1 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.2 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

11.3 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.4 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

11.5 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.6 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

11.7 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.8 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

11.9 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.10 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

11.11 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.12 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况

11.13 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
11.14 基金管理人及基金托管人持有本基金的情况