

## 国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金 LOF)

2013年06月30日

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  
报告送出日期:2013年07月18日

§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责任。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7月16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，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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金中财资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)(场内简称:国投资源)

基金代码 161217 前缀:161217 后缀:161218

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2011年07月21日

报告期末基金份额总额 317,894,348.00份

投资目标 本基金通过被动的指数化投资管理，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准的净值增长率相比较，实现跟踪误差最小化。

投资策略 本基金为被动式指数基金，采用完全复制法即以拟合指数成分股的权重为基准，根据成分股的权重和股数，按期调整基金的资产配置。并根据标的指数的调整规则，定期对基金的资产配置进行调整，以期在跟踪误差和跟踪成本之间取得平衡。配置、增减发行券、或者因标的指数成分股或权重调整导致基金净值有较大变动时，基金管理人将根据基金合同的约定，通过定期报告和临时报告的形式向投资者披露。

本基金通过被动的指数化投资管理，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之差的年化跟踪误差控制在4%以内，同时确保绝对误差的平均值控制在3%以内。

业绩比较基准 95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为股票型基金，属中高风险、较高收益的基金品种，其风险和收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2013年04月01日-2013年06月30日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 -6,009,740.64

2.本期利润 -57,970,761.79

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1834

4.期末基金份额净值 177.988,586.52

5.期末基金资产净值 0.560

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

2.本基金对业绩比较基准采用每季再平衡的计算方法。

3.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

2.本基金对业绩比较基准采用每季再平衡的计算方法。

3.2.1 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 基金净值表现

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.3 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.4 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.5 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.6 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.7 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.8 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.9 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.10 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.11 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.12 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.13 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.14 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.15 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.16 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.17 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.18 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.19 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.20 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.21 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.22 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.23 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.24 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.25 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.26 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.27 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.28 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.29 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.30 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.31 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.32 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.33 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.34 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.35 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.36 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.37 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.38 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.39 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.40 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.41 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.42 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.43 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.44 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.45 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

3.2.46 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的指数基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+