

2014 年度 报告 摘要

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金 (LOF)

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:2015年3月30日

1.1 重要提示
基金管理人承诺:基金资产净值不存在虚假记载,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。
基金托管人承诺:基金资产净值不存在虚假记载,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。

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
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

2.2 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

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4068号平安金融中心46层

3.1 主要财务数据和财务指标
2014年 2013年 2012年 2011年
本期期末基金份额净值 1.0278 1.0278 1.0278 1.0278

3.2 基金净值表现
本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2014年12月31日,本基金净值增长率为2.78%,同期业绩比较基准收益率为2.78%。

3.3 基金投资组合报告
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

3.4 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4068号平安金融中心46层

3.5 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

3.6 基金投资组合报告
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

3.7 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4068号平安金融中心46层

3.8 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

3.9 基金投资组合报告
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

3.10 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4068号平安金融中心46层

3.11 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

3.12 基金投资组合报告
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

3.13 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4068号平安金融中心46层

3.14 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

基金LOF募集的批复核准,由国投瑞银基金管理有限公司依照《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》负责公开募集。
本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次发售募集不包括认购利息共募集726,252,233.160元。

7.1 基金的投资目标
本基金的投资目标是:紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差控制在4%以内。

7.2 基金的投资策略
本基金的投资策略包括:资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。

7.3 基金的风险控制
本基金的风险控制措施包括:资产配置风险控制、股票仓位风险控制、行业集中度风险控制等。

7.4 基金的费用
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4068号平安金融中心46层

7.5 基金的投资业绩
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

7.6 基金的投资组合
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

7.7 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4068号平安金融中心46层

7.8 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

7.9 基金投资组合报告
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

7.10 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4068号平安金融中心46层

7.11 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

7.12 基金投资组合报告
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票 17,656,547.74
债券 18,213,142.26
货币资金 26,106.15

7.13 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4068号平安金融中心46层

7.14 基金业绩说明
本基金通过被动跟踪的指数化投资管理,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪偏离度控制在4%以内。
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值1.0278元,较年初增长2.78%。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例