

信息披露

Disclosure

(上接B039版)

法定代表人:李玮
电话:021-20315290
传真:021-20315137
联系人:许昱华
客服电话:96538
公司网站:www.ztsc.com.cn
(58)第一创业证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
电话:0755-23838751
传真:0755-25838701
联系人:吴军
客服电话:96358
公司网站:www.firstcapital.com.cn
(59)中航证券有限公司
住所:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址:南昌市红谷滩中心区红谷中大道1619号国际金融大厦41层

法定代表人:王晓峰
电话:010-59562468
传真:010-59562637
联系人:王黎雯
客服电话:95365
公司网站:www.avicsec.com
(60)华融证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18楼
法定代表人:黄金琳
电话:021-20655183
传真:021-20655196
联系人:王虹
客服电话:95647
公司网站:www.hfzq.com.cn
(61)华龙证券股份有限公司
住所:甘肃省兰州市城关区东南西路638号兰州财富中心
办公地址:甘肃省兰州市城关区东南西路638号
法定代表人:李晓安
电话:0931-4890208
传真:0931-4890628
联系人:范坤
客服电话:96368
公司网站:www.hlzq.com
(62)中国国际金融股份有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人:丁学东
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联系人:陈曦、杨涵宇、任敏
客服电话:4009101166
公司网站:www.cicc.com.cn
(63)财通证券股份有限公司
住所:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:浙江省杭州市上城区嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
电话:0571-87818329
传真:0571-87818329
联系人:夏吉慧
客服电话:96336(浙江)、40086-96336(全国)
公司网站:www.ctsec.com
(64)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞萍
电话:021-64339000
传真:021-54967293
联系人:杨利娟
客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
公司网站:www.csc.com.cn
(65)瑞银证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层
法定代表人:钱于军
电话:010-58328971
传真:010-58328748
联系人:马牧
客服电话:400-887-8827
公司网站:www.usbssecurities.com
(66)中国中投证券有限责任公司
住所:深圳福田区益田路与福中路交界外贸荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人:高涛
电话:0755-82023697
传真:0755-82025539
联系人:王乃琳
客服电话:400-600-8008、96532
公司网站:www.china-invs.cn
(67)国融证券股份有限公司
住所:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与呈祥路交汇处武川农村商业银行股份有限公司四楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融大厦11层
法定代表人:张智河
电话:010-83991777
传真:010-66412537
联系人:郭一非
客服电话:96385
公司网站:www.grzq.com
(68)联讯证券股份有限公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
电话:0752-2119700
传真:0752-2119660
联系人:陈雄
客户服务热线:95664
公司网站:www.lxsec.com
(69)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-87765732
传真:0451-82337279
联系人:姜志伟
客服电话:400-666-2288
公司网站:www.jhzq.com.cn
(70)国金证券股份有限公司
住所:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86690057、028-86690058
电话:028-86690126
联系人:刘婧鑫、贾鹏
客服电话:96310
公司网站:www.gjzq.com.cn
(71)华宝证券有限责任公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址:上海市浦东新区世博大道1859号1号楼中国宝武大厦7

楼
法定代表人:陈林
电话:021-20657517
传真:021-68777992
联系人:刘娟娟
客服电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com
(72)长城国瑞证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:王勇
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
联系人:赵欣
客服电话:0592-5163588
公司网站:www.wcmzq.com
(73)爱建证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:祝健
联系人:姚盛盛
电话:021-32229888
传真:021-68728703
客服电话:4001-962-502
公司网站:www.aijzq.com
(74)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号

办公地址:北京市朝阳区朝阳门内大街18号中国人寿保险大厦12层
法定代表人:祝献忠
电话:010-85565100
传真:010-85565153
联系人:李慧灵
客服电话:400-898-9999
公司网站:www.hfsec.com.cn
(75)财达证券股份有限公司
住所:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
法定代表人:林义相
联系电话:010-665845515
传真:010-66045518
联系人:谭磊
客服电话:010-66045678
天相投顾网址:www.txsec.com
天相基金网网址:www.jim.com.cn
(77)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:010-85650628
传真:010-65884788
联系人:刘洋
客服电话:400-920-0022
公司网站:licaikexhexun.com
(78)诺亚正行基金销售有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋
法定代表人:汪静波
电话:021-38602377
传真:021-38509777
联系人:张裕
客户服务电话:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com
(79)深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
联系人:童彩平
客户服务电话:4006-788-887
网站:www.zlfund.com和www.jimw.com
(80)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人:其实
联系人:潘世华
电话:021-54509988
传真:021-54605051
客服电话:95021
公司网站:www.1234567.com.cn
(81)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-909室
上海市虹口区欧阳路196号(法兰桥创意园)26号楼2楼
法定代表人:杨文斌
电话:021-20613999
传真:021-68989616
联系人:王诗婷
客户服务电话:400-700-9665
网站:www.ehowbuy.com
(82)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:杭州市西湖区学院路28号德力西大厦1号楼19楼
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
网站:www.fund123.cn
(83)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张庆伟
联系人:邱芳敏
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客服电话:400-820-2899
公司网站:www.erichfund.com
(84)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市余杭区五常大道同顺路18号同花顺大厦4

楼
法定代表人:凌骥平
电话:0571-88911818-8863
传真:0571-86800423
联系人:李珍珍
客服电话:4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com
(85)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇文富街9号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦二层
法定代表人:闫振太
电话:010-59601366
传真:010-62020355
联系人:张云
客服电话:400-818-8000
公司网站:www.mylfund.com
(86)上海大智慧基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102.1103单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102.1103单元
法定代表人:申健
电话:021-20219988
传真:021-20219938
联系人:胡旦
客服电话:021-20292031
公司网站:8.gw.com.cn
(87)上海联泰基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市福泉北路1818号8座3层
法定代表人:尹彬彬
电话:021-52822663
传真:021-52975270
联系人:兰敏
客服电话:400-166-6788
网站:www.661lantai.com
(88)上海汇付基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区黄河路333号201A室056单元
办公地址:上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业二期05栋2楼
法定代表人:金浩
电话:021-54677088
传真:021-33323830
联系人:沈娟、臧静
电话:400-820-2819
网站:https://www.hottijin.com
(89)中信建投期货有限公司
住所:重庆渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A、8-B4、9-B-C
办公地址:重庆渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人:彭文德
电话:023-86769637
传真:023-86769629
联系人:刘芸
客服电话:400-8777-780
公司网站:www.cfc108.com
(90)中信期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
电话:010-60833754
传真:0755-83217421
联系人:刘宏圣
客户服务电话:400-990-8826
网站:www.citicf.com
(91)上海陆金所基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:胡宇婷

联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客户服务电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
(92)珠海盈米基金销售有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网站:www.yingmi.cn
(93)北京肯瑞瑞基金销售有限公司
住所:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部A座17层
法定代表人:陈超
联系人:江卉
电话:010-89189288
传真:010-89188000
客服电话:400 098 8511
网站:http://fund.jd.com/
(94)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向冲
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
公司网站: www.hcjin.com
(95)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18楼
法定代表人:李兴春
传真:021-50583633
联系人:陈夜明
客服电话:400-921-7755
公司官网:www.leadfund.com.cn
(96)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区金沪路65号通华科技大厦7楼
法定代表人:马刚
联系人:庄洁茹
电话:021-60818066
客服电话:06156
公司官网:https://www.tonghuafund.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构为本基金的场外基金代销机构,并及时公告。
3、场内销售机构
本基金的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,包括:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东吴证券、东吴证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中农证券、中安证券、中信建投、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券等。
(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区太平桥大街17号
办公地址:北京西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:(010)59378856
传真:(010)59378907
联系人:崔巍
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:梁金金、刘佳
联系人:廖海
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系人:施朔洲
联系电话:021-23238888
传真:021-23238900
经办注册会计师:薛翼、施朔洲

四、基金的名称

本基金名称: 国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)

本基金类型: 股票型、指数型 基金运作方式: 上市契约开放式(LOF)

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间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,实现对中证上游资源产业指数进行有效跟踪。

七、基金的投资方向
本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小创、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行增发等)、债券、权证、股指期货及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

其中,投资于标的指数成份股及其备选成份股票市值不低于基金资产净值的80%;投资于标的指数成份股及其备选成份股票市值占买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;任何交易日内终了扣除股指期货合约所需缴纳的保证金后,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构以后有《基金合同》与托管协议生效后允许基金投资于其他金融工具,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金管理人应当自《基金合同》生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》约定的。

八、基金的投资策略
1、基本投资策略
本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期指数成份股或权重调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时,或者因市场因素影响或法律法规限制等特殊情况下基金无法有效复制和跟踪标的指数的指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。

本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

2、股指期货的投资
本基金为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金仓位配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)

本基金是以中证上游资源产业指数的指数的被动式、指数型基金,对中证上游资源产业指数的配置基准约为95%,并适度运用股指期货增强跟踪指数跟踪效果,故以此业绩比较基准,能够较为准确地反映本基金的投资业绩。
如果中证上游资源产业指数被停止编制及发布,或者中证上游资源产业指数由其他指数替代(单纯更名除外),或者由于指数编制方法等重大变更导致中证上游资源产业指数不继续作为本基金的投资标的的指数及业绩比较基准或者证券市场有其他代表性强、更适合作为基金业绩比较基准,基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,于变更前2个工作日在指定媒体上予以公告并在变更后5个工作日内报中国证监会备案。

十、基金的风险控制特征
本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	106,439,264.62	91.61
2	固定收益投资	106,439,264.62	91.61
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他各项资产	109,006.19	0.09
8	合计	116,220,467.27	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。
2、报告期末按行业分类的股票投资组合
(1)积极投资按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,566.05	0.02
C	制造业	52,831.09	0.05
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	50,146.80	0.04
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	139,544.05	0.11
合计		139,544.05	0.11

(2)指数投资按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

代	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	63,586,877.17	56.24
C	制造业	29,494,971.00	24.54
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	1,422,500.00	1.24
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	696,302.00	0.62
合计		93,099,748.17	91.64

(3)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。
3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	1,904,411.00	9,617,275.55	8.57
2	601867	中国铝业	1,240,710.00	9,546,519.10	7.78
3	601898	紫金矿业	1,847,246.00	6,169,796.30	5.27
4	601088	中国神华	332,869.00	5,439,394.60	4.73
5	601225	陕西煤业	611,420.00	4,549,949.40	3.93
6	603993	南微医疗	1,094,123.00	4,076,302.40	3.56
7	601600	中国铝业	1,009,191.00	3,582,626.05	3.12
8	600547	山东黄金	113,83.00	3,443,599.50	3.00
9	002466	中国铝业	104,746.00	3,071,152.72	2.67
10	601111	北方稀土	334,299.00	2,931,802.23	2.55

(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
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	工商银行	1,076,010	52,153.00	0.05
2	601860	紫金银行	15,970,000	50,146.80	0.04
3	000003	ST佳木斯	48,303.00	26,566.05	0.02

5、报告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
本基金本报告期末未持有债券。
6、报告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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按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
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
8、报告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
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。
(2)本基金投资股指期货的投资政策
为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金仓位配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数的跟踪效果。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
根据本基金合同约定,本基金不参与国债期货交易。
11、投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
(2)本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。
(3)其他资产构成
金额单位:人民币元

序号	资产名称	金额
1	存出保证金	2,694.00
2	应收证券清算款	40,156.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,961.41
5	应收申购款	64,212.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,006.19

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换。
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
1)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
2)期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	期末公允价值
1	601860	紫金银行	50,146.80	0.04	50,146.80
2	000003	ST佳木斯	26,566.05	0.02	26,566.05

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
十二、基金的投资
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
基金净值表现详见下表:
国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止2018年12月31日)

时间段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	②-①
2011.07.21 (基金合同生效日)起至2011.11.23止	-22.00%	10.0%	-31.30%	16.2%
2012.01.01 至2012.12.31止	4.87%	16.3%	-44.1%	16.3%
2013.01.01至2013.12.31止	-14.11%	14.4%	-34.78%	14.4%
2014.01.01至2014.12.31止	36.16			