

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:2012年3月29日

§ 1 重要提示及信息披露

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和其他从业人员在本基金运作期间不从事损害基金利益的关联交易。本年度报告已经全体独立董事审阅,并由董事会上签发。

基金托管人已对本基金年度报告书所载内容进行复核,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预示其未来表现。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及其摘要。

本年度报告摘要摘自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

报告期:2011年7月21日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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:国投瑞银)

基金主代码:161217

基金名称: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

报告期末基金份额总额:391,843,083.29

2.2 基金产品说明

本基金通过指数的投资管理,力争将本基金的净值增长

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,年内跟踪误差控制在4%以内,实现对中证上游资源产

业指数进行有效跟踪。

本基金为开放式指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪

标的指数,即按照标的指数的权重构造基金股票

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。

为有效控制跟踪的跟踪误差,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。

95%以上资产投资于证券投资基金,其余5%投资于银行活期存款(税后)

或现金类资产。

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市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

名称:国投瑞银基金管理有限公司

住所:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层

6.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要数据报告期和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2011年07月21日-2011年12月31日

本期的实现收益

-79,906,683.81

本期利润

-106,197,896.81

加权平均基金份额本期利润

-0.1921

基金本期份额净值增长率

-2.00%

3.1.2 期末数据和指标

2011年末

期末基金份额净值

305,645,287.70

期末基金份额净值

0.780

注:1.本期已实现收益指基金本期累计收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)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收益。

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中已实现部分的孰低数

数(即期末可供分配利润=期末可供分配利润与本期利润之和-本期利润)。

3.以上所列基金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,计入费用后实际利润将有所下降。

4.本基金合同同生日为2011年7月21日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率为% 份额净值增长率为% 业绩比较基准收益率为%

份额净值增长率为% 份额净值增长率为% 业绩比较基准收益率为%

过去三个月 -16.49% 1.24% -17.90% 1.75% 1.41% -0.51%

自基金合同生效日起至 -22.00% 1.03% -31.30% 1.62% 9.30% -0.59%

3.2.2 基金合同同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金是以中证上游资源产业指数为标的的被动、指数型基金,对中证上游资源产业指数成分股的配置准确率为95%,通过定期调整股票配置比例,能够较为准确地反映基金的投资绩效。

2.本基金对业绩比较基准采用每年重新平衡的计算方法。

3.本基金合同同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.3 基金管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

4.3.1 公平交易的执行情况

本报告期内,基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《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》等有关规定,在公平交易方面,为基金的运作提供了良好的保障,不存在不公平对待不同基金的情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《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》等有关规定,在公平交易方面,为基金的运作提供了良好的保障,不存在不公平对待不同基金的情况。

4.3.3 公平交易执行情况的说明

4.4 管理人对报告期内基金的经营情况和业绩表现的说明

4.4.1 基金管理人及其基金经理的经营情况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、公司拥有完善的人力资源管理、企业文化、社会责任等企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截至2011年12月底,公司经理层18只基金,其中包括2只创新分级基金。

4.4.2 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 年限

刘伟 本基金基金经理 2011年07月21日 - 8

董晓 本基金基金经理 2011年07月21日 - 6

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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金报告期未进行利润分配。

4.5 管理人对报告期内基金的投资运作遵规守信情况的说明

4.5.1 公平交易的执行情况

本报告期内,基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《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》等有关规定,在公平交易方面,为基金的运作提供了良好的保障,不存在不公平对待不同基金的情况。

4.5.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《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》等有关规定,在公平交易方面,为基金的运作提供了良好的保障,不存在不公平对待不同基金的情况。

4.5.3 公平交易执行情况的说明

4.6 管理人对报告期内基金的投资运作遵规守信情况的说明

4.6.1 基金管理人及其基金经理的经营情况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、公司拥有完善的人力资源管理、企业文化、社会责任等企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截至2011年12月底,公司经理层18只基金,其中包括2只创新分级基金。

4.6.2 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 年限

刘伟 本基金基金经理 2011年07月21日 - 8

董晓 本基金基金经理 2011年07月21日 - 6

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。

4.7 管理人对报告期内基金的投资运作遵规守信情况的说明

4.7.1 基金管理人及其基金经理的经营情况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、公司拥有完善的人力资源管理、企业文化、社会责任等企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截至2011年12月底,公司经理层18只基金,其中包括2只创新分级基金。

4.7.2 公司概况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、公司拥有完善的人力资源管理、企业文化、社会责任等企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截至2011年12月底,公司经理层18只基金,其中包括2只创新分级基金。

4.7.3 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 年限

刘伟 本基金基金经理 2011年07月21日 - 8

董晓 本基金基金经理 2011年07月21日 - 6

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。

4.8 管理人对报告期内基金的投资运作遵规守信情况的说明

4.8.1 基金管理人及其基金经理的经营情况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、公司拥有完善的人力资源管理、企业文化、社会责任等企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截至2011年12月底,公司经理层18只基金,其中包括2只创新分级基金。

4.8.2 公司概况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、公司拥有完善的人力资源管理、企业文化、社会责任等企业文化。公司现有员工153人,其中91人具有硕士或博士学位。截至2011年12月底,公司经理层18只基金,其中包括2只创新分级基金。

4.8.3 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 年限

刘伟 本基金基金经理 2011年07月21日 - 8

董晓 本基金基金经理 2011年07月21日 - 6

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。

4.9 管理人对报告期内基金的投资运作遵规守信情况的说明

4.9.1 基金管理人及其基金经理的经营情况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司是中国第一大海外基金管理公司,旗下管理的基金资产规模达9000亿元人民币,注册资本1亿元人民币,办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路4028号易亨超经营范围:46层。

国投瑞银基金管理有限公司(简称“国投瑞银”),公司拥有完善的法人治理结构,建立了有效风险管理及控制架构,从瑞士

银行股份有限公司(UBS AG)、