

国投瑞银全球新兴市场精选股票型证券投资基金 (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
报告送出日期:2015年1月21日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构承诺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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年1月19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内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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,也不保证基金资产不受损失。
基金的投资存在净值并不表示未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银全球新兴市场股票(QDII-LOF)场内简称:国投新兴
基金代码	161210
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月10日
报告期末基金份额总额	35,977,849.87份
投资目标	本基金主要投资于全球新兴市场国家或地区,通过投资对标的精选和组合投资,分散投资,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的投资股票投资管理策略,充分借鉴UBI Global AMFI全球投资股票基金,在精选性基金资产中配置,进行区域或行业等配置的基础上,主要通过精选具有国际竞争力或成长性强的全球新兴市场国家或地区股票,本基金主要投资于全球新兴市场的证券,因此具有较大的新兴市场投资比例和波动性。
业绩比较基准	摩根士丹利新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index/Net Total Return)
风险收益特征	本基金为全球投资股票型证券投资基金,属于较高风险和预期收益的股票投资基金,其预期收益和风险水平高于证券投资基金和债券基金。由于投资资产与境外市场的风险,风险较投资于单一市场的股票型基金要高,本基金主要投资于全球新兴市场的证券,因此具有较大的新兴市场投资比例和波动性。
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
境外投资顾问	英文名称:UBI Global Asset Management (Singapore) Ltd 中文名称:瑞银资产管理(新加坡)有限公司
境外资产托管人	英文名称:Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited 中文名称:渣打银行(香港)有限公司

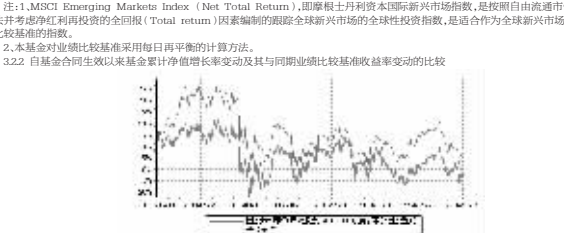
§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,152,158.65
2.本期利润	-946,407.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0264
4.期末基金份额净值	31,183,896.05
5.期末基金份额净值	0.978

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.以上所述基金净值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 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自上月至今	-2.66%	0.09%	-5.39%	0.83%	2.73%	0.74%

注:1. MSCI Emerging Markets Index (Net Total Return),该指数为并开美国国际新兴市场股票,该指数由美国纽约摩根士丹利标准普尔指数公司(Stoxx)编制,该指数的跟踪全球新兴市场的全线性投资组合,是适合作为全球新兴市场股票型证券投资基金的业绩比较基准。
2. 本基金净值增长率采用四舍五入再开平方根的计算方法。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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,本基金各资产配置比例符合招股说明书有关投资比例的规定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
陈海峰	本基金基金经理	2012年3月10日		15	中国籍,硕士,具有基金从业资格,美国证券分析师(CFA),曾任职于平安基金、摩根大通等,2012年加入国投瑞银,现任国投瑞银全球新兴市场股票型证券投资基金基金经理(CIA)。

注:报告期内和报告期期间公司没有出现法定正式对外公告之日,证券从业的公告从人行证监会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	国籍	境外投资顾问公司职务	证券从业年限	说明
Ye-Ming Shih	美国	瑞银资产管理(新加坡)有限公司董事总经理,兼任新兴市场及地区投资组合经理	24	毕业于新加坡国立大学,美国特許金融分析师(CFA)。
Bao Chieh	美国	董事(不含日本)地区投资组合经理	20	毕业于美国Tulane大学,美国特許金融分析师(CFA)。
Guofeng Wang	中国	瑞银资产管理(新加坡)有限公司董事总经理,兼任新兴市场及地区投资组合经理	26	毕业于美国威斯康星大学,美国特許金融分析师(CFA)。

4.3 管理人对报告期内本基金基金运作情况的说明

在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规及《国投瑞银全球新兴市场股票型证券投资基金(LOF)基金合同》等相关规定,恪守诚信、勤勉尽责,忠实履行受托职责,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产,在报告期内,基金的投资决策流程、基金运作符合法律法规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易情况说明

4.4.1 公平交易制度执行情况说明
报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期不存在有异常交易行为。
本基金管理人严格执行了公平交易制度,在报告期内没有出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交总量5%的情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩比较基准

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.6 报告期内基金的投资组合报告

截至报告期末,本基金份额净值为0.978元,本报告期份额净值下降2.66%,同期MSCI新兴市场指数(人民币计价)下降5.36%,超额收益为2.72%,主要来自于本基金对中以科技股的超配。

4.7 报告期内基金持有人或资金中持有本基金的情况,及持有本基金的比例变化情况

本报告期末本基金前二十个工作日基金份额持有人持有6000万以上的份额,本报告期末(12月31日)仍持有6000万以上,基金管理人根据相关规定在本报告期内未对基金份额持有人进行任何限制。

4.8 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.9 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.10 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.11 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.12 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.13 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.14 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.15 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.16 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.17 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.18 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.19 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.20 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.21 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.22 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.23 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.24 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.25 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.26 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.27 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.28 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.29 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.30 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

4.31 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保各基金管理人旗下基金在研究、决策、交易执行等各个环节得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析和评估,确保各基金公平交易和风险控制的有效性,形成了较为公平的交易体系。本报告期,本基金管理人各条公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,本基金存在违反公平交易制度的情况。

注:1.由于本基金投资组合的资产100%跟踪标的股票基金,跟踪误差在报告期内一直控制在跟踪误差率不高于基金资产净值0.1%,因此,本基金业绩比较基准为95%+跟踪100个标的股票基金+5%跟踪跟踪误差率(0.1%)。

2.本基金净值增长率采用四舍五入再开平方根的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合招股说明书有关投资比例的规定。

4.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-45,096,955.36
2.本期利润	1,774,015,525.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2423
4.期末基金份额净值	8,647,403,383.38
5.期末基金份额净值	1.186

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.以上所述基金净值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 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自上月至今	1.41%	0.26%	1.41%	0.83%	-0.57%	0.00%

注:1.由于本基金投资组合的资产100%跟踪标的股票基金,跟踪误差在报告期内一直控制在跟踪误差率不高于基金资产净值0.1%,因此,本基金业绩比较基准为95%+跟踪100个标的股票基金+5%跟踪跟踪误差率(0.1%)。

2.本基金净值增长率采用四舍五入再开平方根的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合招股说明书有关投资比例的规定。

4.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-45,096,955.36
2.本期利润	1,774,015,525.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2423
4.期末基金份额净值	8,647,403,383.38
5.期末基金份额净值	1.186

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.以上所述基金净值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 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自上月至今	1.41%	0.26%	1.41%	0.83%	-0.57%	0.00%

注:1.由于本基金投资组合的资产100%跟踪标的股票基金,跟踪误差在报告期内一直控制在跟踪误差率不高于基金资产净值0.1%,因此,本基金业绩比较基准为95%+跟踪100个标的股票基金+5%跟踪跟踪误差率(0.1%)。

2.本基金净值增长率采用四舍五入再开平方根的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合招股说明书有关投资比例的规定。

4.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-45,096,955.36
2.本期利润	1,774,015,525.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2423
4.期末基金份额净值	8,647,403,383.38
5.期末基金份额净值	1.186

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.以上所述基金净值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 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自上月至今	1.41%	0.26%	1.41%	0.83%	-0.57%	0.00%

注:1.由于本基金投资组合的资产100%跟踪标的股票基金,跟踪误差在报告期内一直控制在跟踪误差率不高于基金资产净值0.1%,因此,本基金业绩比较基准为95%+跟踪100个标的股票基金+5%跟踪跟踪误差率(0.1%)。

2.本基金净值增长率采用四舍五入再开平方根的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合招股说明书有关投资比例的规定。

4.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-45,096,955.36
2.本期利润	1,774,015,525.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2423
4.期末基金份额净值	8,647,403,383.38
5.期末基金份额净值	1.186

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.以上所述基金净值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 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自上月至今	1.41%	0.26%	1.41%	0.83%	-0.57%	0.00%

注:1.由于本基金投资组合的资产100%跟踪标的股票基金,跟踪误差在报告期内一直控制在跟踪误差率不高于基金资产净值0.1%,因此,本基金业绩比较基准为95%+跟踪100个标的股票基金+5%跟踪跟踪误差率(0.1%)。

2.本基金净值增长率采用四舍五入再开平方根的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合招股说明书有关投资比例的规定。

4.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-45,096,955.36
2.本期利润	1,774,015,525.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2423
4.期末基金份额净值	8,647,403,383.38
5.期末基金份额净值	1.186