

鹏华中证500指数证券投资基金 LOF

2012 第四季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
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1月22日

8) 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中,力求做到内容真实、准确、完整,但不对其内容的真实性、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基金合同规定,于2013年1月17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,也不保证最低收益。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2013年1月1日起生效。
本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

基金简称	鹏华中证500指数(LOF)
基金代码	160616
交易代码	160616
基金运作方式	契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年5月2日
报告期末基金份额总额	1,200,228,393.59份
投资目标	本基金采用被动式指数投资方法,紧密跟踪中证500指数的表现,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将跟踪偏离度控制在0.35%以内,中跟踪偏离度控制在4%以内,以实现对中国中证500指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,紧密跟踪中证500指数的表现,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将跟踪偏离度控制在0.35%以内,中跟踪偏离度控制在4%以内,以实现对中国中证500指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,具有较高风险、较高预期收益和资产净值波动高于市场基金(债券基金、货币基金、为证券投资基金中的较低风险、较低预期收益品种)。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称为“鹏华500”。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-80,806,561.59
2.本期利润	17,544,971.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0134
4.期末基金资产净值	822,238,684.41
5.期末基金净值增长率	0.68%

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.所投资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,开放式基金的申购赎回费、基金转换费),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

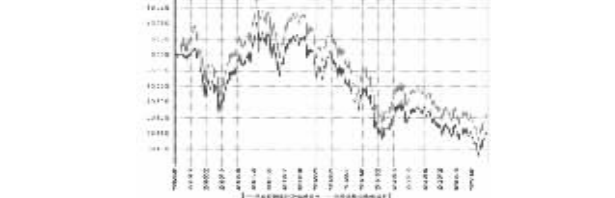
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	1.78%	1.38%	2.30%	1.37%	-0.52%	0.01%

注:业绩比较基准=中证500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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:1.本基金合同于2010年2月5日生效。
2.截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.1 基金经理 戚基金经小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
方南	基金基金经理	2010年2月5日 - 10	10	方南先生,国籍中国,工商管理硕士,10年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司、上海新科金数字技术有限公司。2001年11月加盟鹏华基金管理有限公司,历任金融工程部(原)研究员、金融工程部(原)总经理助理、鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理。2010年2月至2012年9月兼任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理。2010年8月至今兼任鹏华上证央企50ETF基金及其联接基金基金经理。2011年9月起兼任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理。方南先生具备基金从业资格,本报告期内,本基金基金经理未发生变动。

注:1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2.证券投资基金的基金经理由行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

3.基金经理对报告期内本基金投资遵守信情况的说明:报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规,中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规并且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过当日成交量的5%的交易次数为3次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第四季度的市场走势特征“触底重生”的意味,高层换届后市场的超预期反弹以结构经济数据的向好,使前期在悲观预期下被压抑的做多情绪得以释放,市场逐步走出12月份的反跌。整个季度的波动幅度较大,“触底重生”的意味,对基金的管理运作带来一定影响,面临这种情况,我们进行了积极的管理,较好的控制了跟踪误差控制目标。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如果我们有必要再次强调上季度季报的观点:从A股市场估值水平来看,已经阶段性包含了经济增速下降的预期,也许,由于短期内估值水平下降过快反映出预期的过分悲观上,“十八大换届”的诸多憧憬也许会在第四季度的市场带来长期反弹的契机,但这并不代表中国经济基本面的实质方向有变,只要预期的库存周期和通胀动力未能出现趋势性变化,那么在这种市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制,同时,我们也要继续密切关注我们前期的预期情况,现在所关注的是:市场逐步认同的“新型城镇化”等乐观预期因素能否在相当程度上“接棒”通胀,能否对未来经济发展的模式和方向增添新的动力和指引,这将影响着市场趋势。反之,“稳增长”的定性,这要比讨论所谓“估值修复”要来的更深、更有指导意义。

4.6 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.7 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.8 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.9 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.10 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.11 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.12 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.13 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.14 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.15 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.16 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.17 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.18 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.19 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.20 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.21 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.22 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.23 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.24 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.25 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.26 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.27 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.28 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.29 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.30 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.31 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.32 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.33 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.34 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008%,跟踪误差0.558%,较好地完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期的跟踪误差主要来自两个方面:一是基金管理人面临了一定的跟踪误差,而期间市场波动较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;二是目前的份额净值计算精度。

跟踪误差的计算保留到小数点后4位,小数点后第4位(四舍五入)所带来的跟踪误差,这是由跟踪误差的主要来源之一。

4.35 报告期内基金业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为0.68%,累计净值0.685元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%。

报告期内,本基金1月跟踪偏离度绝对值为0.008