

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26日
§ 1 提示性说明
基金管理人的承诺及基金份额持有人对本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,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:国投瑞银基金管理有限公司根据《基金合同》的约定,于2015年10月22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,保证复核结果不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺就本基金的管理费、托管费、申购赎回费等向投资人披露,投资人有权查阅。投资人有权阅读本基金的招募说明书。
本基金在运作期间不收取赎回费。
本基金自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国投瑞银新兴市场股票(ODI-LOF)

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 49,196,601.03份

投资目标 本基金主要投资于全球新兴市场国家或者地区,通过对投资对象的筛选和组合投资,分散投资风险,力图实现基金资产中长期稳定的增值。

投资策略 本基金将采取积极的投资风险管理策略,充分借鉴UBS Global AM的全球投资经验,通过深入研究不同国家和地区的经济、政治、社会、文化、历史、地理、民族、宗教、资源、金融、法律、制度、政策、产业结构、行业分布、区域发展水平、宏观经济环境、国际市场状况、投资品种的特征以及投资对象的特性,寻求在不同的风险收益管理下的合理的投资组合,力求实现基金资产中长期稳定的增值。

业绩比较基准 摩根士丹利新兴市场指数(MSCI Emerging Market Index (Net Total Return))

风险收益特征 本基金为股票型证券投资基金,具有较高的风险,预期收益水平高于债券型基金和混合型基金,低于股票型基金。本基金主要投资于全球新兴市场国家或者地区,因此本基金的汇率风险显著。

基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

英文名称 Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited

中文字称 港银银行(香港)有限公司

§ 3 主要财务指标

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -6,259,985.06

2.本期利润 -10,326,814.07

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1924

4.期末基金份额净值 37,974,999.28

5.期末基金资产净值 0.768

注:本报告期收入项目按基金利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、利息收入、手续费收入、其他费用之和计算加总。

2.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.2.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.2.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.3 基金净值表现

3.3.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.3.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.3.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.4 基金净值表现

3.4.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.4.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.4.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.5 基金净值表现

3.5.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.5.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.5.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.6 基金净值表现

3.6.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.6.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.6.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.7 基金净值表现

3.7.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.7.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.7.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.8 基金净值表现

3.8.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.8.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.8.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.9 基金净值表现

3.9.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.9.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.9.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.10 基金净值表现

3.10.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.10.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.10.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.11 基金净值表现

3.11.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的逐步企稳,投资者的悲观情绪将有望改善,从而推动香港市场的价值回归。

3.11.2 本基金对业绩基准的贡献及偏离情况

本基金对业绩基准的贡献及偏离情况的计算公式为:基金对业绩基准的贡献=基金对业绩基准的偏离×基金对业绩基准的偏离系数。

3.11.3 上述基金业收入项目不包括买入认购或交易基金的费用(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所示。

3.12 基金净值表现

3.12.1 本基金的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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率 净值增长差额 净值增长差额标准差

过去三个月 -10.9% -10.23% 1.40% -0.37% 1.41%

注:MSCI Emerging Market Index (Net Total Return),即摩根士丹利新兴市场指数,是按照自由流通市值调整方法并考虑红利再投资的全部新兴市场的股价指数,以MSCI中国指数作为参考,2015年香港上市公司的占比在90%左右,远低于其他主要股票市场,可以认为香港是全球股市中的一个估值洼地;此外,我们认为中国的宏观风险远大于大多数的新兴市场国家,投资者对中国经济以及股市已经过于悲观。我们预期随着中国经济的