

信息披露 Disclosure

大成沪深300指数证券投资基金

2013 年度报告摘要

本基金前中期和份额交易情况均较为平稳。本基金在基金合同允许的范围内严格按照标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

基于以上的分析，我们对明年A股市场仍然持相对悲观的态度。在实体经济和金融市场都在“去杠杆化”的环境下，牛市诞生的概率较小。仍然期待Q2的企稳退出，对外来就不充裕的资金量更是雪上加霜，除非有意外输入注入新的资金，预计A股市场将维持下行。股票流动性不断增加，有限的场内资金进行博弈，将进一步加剧市场的结构性矛盾。除了大小盘轮动效应外，板块内部调整也会产生分化，只有少数板块真正优秀个股才有较大涨幅。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关规定，紧密跟踪标的指数，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，努力使跟踪误差的最小化。

4.6 管理人认为，大成基金份额资产净值的变动，主要取决于标的指数成分股权重以市值权重的变化及时调整投资组合。本年年化跟踪误差是1.75%，日均跟踪误差0.08%，各项操作与目标符合基金合同的要求。

截止本报告期末，本基金份额资产净值为0.7386元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.65%，高于业绩比较基准的表现。

4. 管理人认为，宏观经济、证券市场及行业走势均呈现震荡。数据跟踪显示，宏观经济增速仍然在低位徘徊，还未有回升的迹象。实体经济处境比较艰难，传统行业尤甚，虽然“中企会已经提出了”请改革方案，但其落实力度还有待确认，而且也很难在短期间内见效，经济在近期难以低谷回升的可能性较大。

由于经济结构调整的阵痛，若政府改革决心较大，则货币政策料将继续宽松，即使进入新的年度短期资金压力有所缓解，仍难以摆脱流动性紧张的局面。至于财政政策，在政府债务存量已经较大的情况下，亦难有较大动作。

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	76,580,437.99	1.38
2	601318	中国平安	60,683,502.28	1.11
3	600016	民生银行	37,777,523.41	0.67
4	000033	美的集团	30,199,381.44	0.53
5	600837	海通证券	26,342,727.79	0.47
6	601166	兴业银行	26,303,178.52	0.46
7	600332	白云山	20,133,559.94	0.36
8	600637	百润通	19,885,507.18	0.35
9	002450	广信通	19,342,441.62	0.34
10	002236	大华股份	18,597,755.06	0.33
11	600018	上海机场	18,587,138.15	0.33
12	000002	万科A	16,725,203.00	0.30
13	601991	光大发电	16,516,265.69	0.29
14	601039	建发股份	16,488,289.88	0.29
15	000770	中国三三	16,135,118.16	0.29
16	600000	浦发银行	15,934,122.85	0.28
17	600336	新华保险	15,624,407.02	0.28
18	600030	中信证券	15,276,615.80	0.27
19	600086	国投证券	12,922,219.06	0.23
20	600887	伊利股份	12,330,802.19	0.22

注：本期累计买入金额中包含买入成交金额，成交金额以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	107,611,576.31	1.87
2	600016	民生银行	95,341,450.35	1.73
3	600837	海通证券	57,232,583.94	1.01
4	601166	兴业银行	56,380,334.78	0.99
5	601318	中国平安	54,567,099.91	0.96
6	000032	万科A	48,807,312.02	0.86
7	601328	交通银行	47,451,565.52	0.84
8	600000	浦发银行	47,345,177.50	0.83
9	601039	建发股份	45,373,533.80	0.80
10	600030	中信证券	40,179,314.53	0.71
11	000770	中国三三	32,870,768.26	0.58
12	600887	伊利股份	30,213,810.41	0.53
13	600827	华鲁恒升	30,199,381.44	0.53
14	000051	格力电器	30,093,029.24	0.53
15	600519	贵州茅台	27,355,931.88	0.48
16	601088	中国神华	26,686,557.47	0.47
17	601601	中国太保	25,582,086.66	0.45
18	601288	农业银行	23,962,588.15	0.42
19	000001	平安银行	22,416,293.51	0.40
20	600014	上汽集团	21,231,253.21	0.38

注：本期累计卖出金额中包含卖出成交金额，成交金额以成交数量，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本/公允价值与卖出股票的成本/公允价值

单位：人民币元	买入股票的成本/公允价值	卖出股票的成本/公允价值
买入股票的成本/公允价值	1,445,524,849.39	
卖出股票的成本/公允价值	2,424,306,636.13	

注：上述金额均指成交金额（成交金额以成交数量，不考虑相关交易费用）。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	中期票据	208,838,000.00	4.81
4	企业债	208,838,000.00	4.81
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	可交换	-	0.00
8	合计	208,838,000.00	4.81

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	130236	13国债36	600,000	59,586,000.00	1.37
2	130218	13国债18	500,000	49,685,000.00	1.14
3	130243	13国债43	500,000	49,650,000.00	1.14
4	130248	13国债48	300,000	29,949,000.00	0.69
5	110206	11国债06	200,000	19,968,000.00	0.46

8.7 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

8.8 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

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细