

广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2016年1号

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
时间:二零一六年三月

【重要提示】

本基金于2015年5月26日经中国证监会证监许可[2015]985号文注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金前应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式基金,特定风险还包括:基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险等等。本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数沪深300的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

投资者申购的基金份额当日可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;即在目前结算规则下,T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T+1日不得卖出和赎回,T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理机构若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

投资者投资本基金时需具有上海证券账户,但需注意,使用上海证券交易所以基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要使用沪深300指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所以A股账户;如投资者需要使用沪深300指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则还应开立深圳证券交易所A股账户。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年2月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日。

第一部分 基金管理人

一、概况

- 1.名称:广发基金管理有限公司
- 2.住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
- 3.办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
- 4.法定代表人:王志伟
- 5.成立时间:2003年8月5日
- 6.电话:020-83936666
- 全国统一客服热线:95105828
- 7.联系人:段西军
- 8.注册资本:1.2688亿元人民币
- 9.股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”),烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团股份有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司,分别持有本基金管理人51.13%、15.763%、15.763%、9.458%和17.881%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师。兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省政府法律咨询顾问委员会企业家协会,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广东省第十届政协委员,广发证券董事长兼党委书记,广东发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅行政处人事科科长等职务。

林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长、瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行总部常务副总经理。

孙晓燕:董事,女,硕士,现任广发证券副总裁、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事、证通股份有限公司监事,监事长。曾任广东广发证券分公司投资银行部经理,广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理,广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俊:董事,男,管理学硕士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火滕光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火滕仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏证信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉烽火机电信息技术有限公司、成都大唐线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事;兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、滕光烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团(集团)有限公司法定代表人,香江集团有限公司总裁,深圳市金马海实业股份有限公司董事长,深圳香江控股股份有限公司董事长。兼任全国政协委员、全国工商联常委、中国产业发展促进会副会长、广东省工商联副主席、广东省女企业家协会会长、深圳市政协常委、香江社会救助基金会主席,深圳市深南控股集团(集团)有限公司董事,广东南粤银行董事,深圳龙岗安村镇银行董事,广发证券股份有限公司监事。

许冬瑾:董事,女,工商管理硕士,主管药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理,兼任中国中药协会中药饮片专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会委员、全国中药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员、国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中成药炮制与配置工专业专家委员会副主任委员、广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海四联乐马律师事务所兼职律师,绍兴银行独立董事,海尔施生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系主任,复旦大学法学院副院长。

姚海森:独立董事,男,经济学博士、教授、博士生导师,本人现任辽宁大学新华国际商学院教授,兼任东北制药(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院院长、工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记。

罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任中华联合保险控股股份有限公司常务副总裁,兼任中华联合财产保险股份有限公司总裁(法人代表)。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司

总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险公司总经理助理,太平保险中国副总经理兼纪委书记,民安保险(中国)有限公司副总裁,阳光财产保险股份有限公司总裁,阳光保险集团执行委员会委员。

2.监事会成员

余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。

匡丽军:监事,女,工商管理硕士,高级涉外秘书,现任广州科技风险投资有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任,广州屈臣氏公司行政主管,广州科达实业发展公司办公室主任、总经理,广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉:监事,男,工学硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分工会主席。曾任广发证券电脑中心员工、副经理、经理。

3.总经理及其他高级管理人员
林传辉:总经理,男,大学本科学历,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行总部常务副总经理。

朱平:副总经理,男,硕士,经济师,中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海荣臣集团市场部经理,广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理,易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理有限公司总经理助理。

易阳方:副总经理,男,经济学硕士,经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发聚丰股票型证券投资基金基金经理,广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事,瑞元资本管理有限公司董事。

曾任广发证券投资自营部副经理,中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员,广发基金管理有限公司投资管理部总经理,广发基金管理有限公司总经理助理,广发制造业精选股票基金基金经理。

段西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

邱春杨:副总经理,男,经济学博士,瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员,广发基金管理有限公司机构理财部副经理、金融工程部副经理、产品总监、金融工程部总经理。

4.基金经理

刘杰,男,中国籍,工学学士,11年基金从业经历,持有中国证券投资基金从业证书,2004年7月至2010年11月在广发基金管理有限公司从事技术管理工作,2010年11月至2014年3月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员,2014年4月1日至2016年1月17日任广发沪深300指数的基金经理,2014年4月1日起任广发中证500ETF以及广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理,2015年8月20日起任广发沪深300ETF基金的基金经理,2016年1月18日起任广发沪深300ETF联接基金的基金经理,2016年1月25日起任广发中小板300ETF及联接基金、广发养老指数和广发环保指数的基金经理。

5.本基金投资决策集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:
主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平,公司副总经理易阳方,权益投资一部总经理刘晓龙,研究发展部总经理孙迪,固定收益部总经理张芊。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-61605799
联系人:洪洲

(二)主要人员情况
截至2015年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工205人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科学历以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务业务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QDII资产、ODII资产、股权投资基金、证券集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理计划、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年9月,中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003年以来,本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内权威财经媒体评选的49项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和好评。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1.发售协调人
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州市广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87557985
客服电话:95575或致电各地营业网点
客户网站:www.gf.com.cn

2.网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构
本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司、直销销售柜台为投资者办理本基金的开户、认购等业务:
(1)广州分公司
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东裙楼4楼
直销中心电话:020-8989073 020-89899042
传真:020-89899069 020-89899070

(2)北京分公司
地址:北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球讯中心D座11层
电话:010-68083368
传真:010-68083078

(3)上海分公司
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室
电话:021-68885310
传真:021-68885200

(4)投资者也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关业务的查询和投诉等。

3.网上现金发售代理机构

本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的上海证券交易所会员单位(具体名单可在上海证券交易所网站查询)。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

4.网下股票发售代理机构
公司名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87557985
客服电话:95575或致电各地营业网点
客户网站:www.gf.com.cn

二、登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
联系人:崔巍
电话:010-59378867
传真:010-59378907

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师(广州)事务所
住所:广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层
负责人:程棣
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:黄贞、陈桂华
联系人:程棣

四、审计基金资产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯珺
联系人:洪晓明
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:王明静、吴迪

第四部分 基金的目标
广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金

第五部分 基金类型
股票型基金

第六部分 基金的投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

第七部分 基金的投资方向
本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的其他股票)、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

在建仓完成后,本基金股票资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。

第八部分 基金的投资策略

一、投资策略
本基金主要采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股票的结构及其权重构建股票资产组合,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。本基金股票资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%。

为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

正常情况下,本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

二、投资管理程序
研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机结合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

1.研究:数量投资部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析,及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据。

2.投资决策:投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资的日常管理。

3.组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理主要在完全复制标的指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

4.交易执行:交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

5.绩效评估:绩效评估与风险管理组定期和不定期对基金的投资绩效进行评估,并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成败与否,基金经理可以据此总结和检讨投资策略,进而调整投资组合。

6.组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

第九部分 基金的业绩比较基准
本基金的标的指数为沪深300指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

第十部分 基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

第十一部分 基金投资组合报告

本基金管理人董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本合同规定,于2016年3月30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。

本投资组合报告所载数据截至2015年12月31日,本报告期内所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	28,424,501.88	95.67
其中:股票	28,424,501.88	95.67	
2	固定收益投资	2,900.00	0.01
其中:债券	2,900.00	0.01	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,202,086.60	4.06
8	其他各项资产	80,914.93	0.27
9	合计	29,710,403.41	100.00

注:上表中的股票投资项含可替代款估值增值,而下表中的合计项不含可替代款估值增值。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

1)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	21,924,400	0.08
B	采矿业	970,335.00	3.33
C	制造业	8,681,247.16	29.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,067,957.00	3.73
E	建筑业	1,003,385.00	3.44
F	批发和零售业	551,908.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	958,185.00	3.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,598,377.00	5.48
J	金融业	10,780,395.00	36.56
K	房地产业	1,478,036.72	5.07
L	租赁和商务服务业	281,280.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	274,627.00	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,284.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	542,144.00	1.86
S	综合	169,027.00	0.58
合计		28,424,501.88	97.43

2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	38,200	1,375,200.00	4.71
2	600016	民生银行	101,300	976,532.00	3.35
3	600036	招商银行	93,000	965,400.00	3.27
4	600000	浦发银行	33,400	610,218.00	2.09
5	601166	兴业银行	35,700	609,399.00	2.09
6	000002	万科A	23,800	581,434.00	1.99
7	600030	中信证券	29,600	572,760.00	1.96
8	601189	北京银行	47,800	503,334.00	1.73
9	601328	交通银行	73,100	470,764.00	1.61
10	600837	海通证券	23,000	363,800.00	1.25

4.报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	2,900.00	0.01
8	商业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,900.00	0.01

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	银联转债	29	2,900.00	0.01

6.报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.报告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

本基金本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。
(2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。
(2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1)本基金报告期内前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(2)报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	80,914.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2