

信息披露 Disclosure

（上接B093版）

传真:0651-2207965
 网址:www.gyqz.com.cn
 64. 瀚湖证券股份有限公司
 注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
 法定代表人:王春峰
 联系人:蔡耀
 电话:022-28451991
 传真:022-28451892
 客服电话:4008515888
 联系人:郭刚
 电话:0351-8686659
 传真:0351-8686619
 网址:www.jl618.com.cn
 66. 方正证券股份有限公司
 注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二股华侨国际大厦22-24层
 法定代表人:翟志
 客服电话:96571
 联系人:徐福福
 电话:010-57398062
 传真:010-57398058
 网址:www.fundsec.com
 67. 东北证券股份有限公司
 注册地址:长春市生态大街6666号
 办公地址:长春市生态大街6666号
 法定代表人:李福春
 客服电话:95330
 联系人:安岩岩
 电话:0431-85096517
 传真:0431-85096795
 网址:www.nesc.cn
 68. 上投证券有限责任公司
 注册地址:上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼
 法定代表人:李俊杰
 客服电话:021-962518, 4008918918
 联系人:许晔华
 电话:021-53519838
 传真:021-5308530
 网址:www.962518.com
 69. 平安证券股份有限公司
 办注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
 法定代表人:何之江
 客户服务热线:95511-8
 联系人:王阳
 电话:021-38632136
 传真:021-58891896
 网址:http://stock.pingan.com
 70. 华安证券股份有限公司
 注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
 法定代表人:李工
 客服电话:0651-96518, 400-80-96518
 联系人:甘霖
 电话:0651-5161821
 传真:0651-5161672
 网址:www.hazq.com
 71. 招商证券股份有限公司
 注册地址:广东省深圳市福田区福益路46号
 办公地址:广西南宁市滨湖路46号
 客服电话:0755-83333333
 传真:0755-83333333
 联系人:王彦
 客服电话:0651-400-8888-588
 网址:www.longone.com.cn
 74. 华泰证券股份有限公司
 注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
 法人代表:熊介民
 客服电话:0471-4961269
 联系人:魏巍
 电话:0471-3853168
 传真:0471-4930707
 网址:www.cnht.com.cn
 75. 宏信证券有限责任公司
 办公地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
 法人代表:吴玉明
 客服电话:4008396366
 联系人:刘文海
 电话:02886199765
 传真:02886199533
 网址:www.hx818.com
 76. 南京证券股份有限公司
 办公地址:南京市玄武区大钟8号
 法定代表人:步国辉
 客服电话:95366
 联系人:石健
 电话:025-83367888
 传真:025-83364032
 网址:www.njqz.com.cn
 77. 民生证券股份有限公司
 地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
 法定代表人:李政
 客服电话:4008198888
 联系人:赵明
 联系电话:010-85127622
 服务传真:010-85127917
 公司网址:www.msizq.com
 78. 联讯证券股份有限公司
 注册地址:北京市朝阳区北三环西路99号院1号楼15层1501
 法定代表人:张建军
 联系人:王鑫
 客服电话:020-38296651
 客服电话:400-8888-133
 网址:www.wlqz.com.cn
 79. 华信证券股份有限公司
 注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
 法定代表人:杨锦祥
 客户服务热线:4008888818
 联系人:金莎男
 电话:0755-83026723
 传真:0755-83026991
 网址:www.hx168.com.cn
 80. 爱建证券有限责任公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
 法定代表人:钱俊
 客服电话:40011-962-502
 联系人:陈敏
 电话:021-32229888
 传真:021-62578783
 网址:www.aijzq.com
 81. 天风证券股份有限公司
 注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区东园路2号高科大厦四楼
 法定代表人:余磊
 联系人:崔媛
 联系电话:(027)87618882/(027)88711410
 传真:(027)87618933
 网址:www.tfzq.com
 82. 大通证券股份有限公司
 注册地址:大连市中山区人民路24号
 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层
 法定代表人:李红光
 联系人:谢立
 电话:0411-39991807
 传真:0411-39673219
 客户服务热线:4008-169-169
 网址:www.daton.com.cn
 83. 中广证券有限责任公司
 注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
 办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
 法定代表人:陈忠志
 电话:010-88085858
 传真:010-88085195
 联系人:李魏
 客服电话:400-800-0562
 网址:www.hysyc.com
 84. 中航证券有限公司
 注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
 法人代表:王宜四
 客户服务热线:4008866667
 联系人:戴菁
 电话:0791-86769881
 传真:0791-86770178
 网址:www.avicsec.com
 85. 华龙证券有限责任公司
 注册地址:甘肃省兰州市静宁路300号
 法定代表人:韩晓
 联系人:杨晓冬
 联系电话:0931-5794509
 传真:0931-4890619
 甘肃省客服电话:96688
 网址:www.hljzq.com
 86. 中国国际金融有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦
 法定代表人:丁宇东
 联系人:杨颖华
 电话:010-65051166
 网址:www.ciccs.com.cn
 87. 川证证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
 法定代表人:黄涛
 联系人:罗艺璇
 联系电话:0755-82570586
 客服电话:400-1022-011
 网址:www.zxzq.com.cn
 88. 九州证券股份有限公司
 注册地址:海南省西昌市南川工业园区创业路108号
 办公地址:北京市朝阳区安立路30号山公园东112号楼
 法人代表:林兆雄
 电话:010-57672000
 统一客服电话:95305
 89. 国金证券股份有限公司
 注册地址:成都市东城根上街95号
 客服电话:4006600109
 联系人:刘婧璇
 电话:028-86950057
 传真:028-86960126
 客服电话:95310
 网址:www.gjzq.com.cn
 90. 联讯证券股份有限公司
 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
 法人代表:陈刚

联系人:郭靖
 联系电话:0752-2119391
 客服电话:0564
 网址:www.lxqz.com.cn
 91. 中创期货有限公司
 注册地址:深圳市福田区中信三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 办公地址:深圳市福田区中信三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 法定代表人:李路
 联系人:魏芳
 电话:010-60833782
 联系电话:010-60833754
 传真:0756-83217421
 客服电话:400-980-9826
 网址:www.citicsf.com
 92. 第一创业证券股份有限公司
 地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座9楼F
 法人代表:刘学民
 电话:95358
 网址:www.firstcapital.com.cn
 93. 北京钱景基金销售有限公司
 注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
 办公地址:北京市海淀区中关村金融大厦(升棱soho)1008
 法定代表人:赵春泰
 联系人:魏芳
 网站:www.qianjing.com
 客服电话:400-893-6885
 94. 天相投资顾问有限公司
 注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
 法定代表人:林义相
 客服电话:010-66045678
 联系人:尹伶
 传真:010-66045672
 网址:www.txsc.com
 95. 聚利(杭州)基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
 法人代表:魏青
 联系人:韩爱彬
 电话:021-60897940
 传真:0571-26697013
 客服电话:4000-766-123
 网址:www.fund123.com
 96. 诺亚正行基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区飞盘路360弄9号3724室
 法定代表人:汪静波
 办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
 联系人:徐斌
 客服电话:021-38506039
 网址:www.noah-fund.com
 97. 和讯信息科技有限公司
 注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 法定代表人:王莉
 联系人:刘洋
 联系电话:021-20835785
 网站:021-20835879
 客服电话:400-920-0022
 网址:http://licaike.hexun.com
 98. 浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
 办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
 法人代表:凌南平
 联系人:林海海
 电话:0571-88911818-85007
 传真:0571-88911818-85002
 客服电话:4008-773-772
 网站地址:www.5ifund.com
 99. 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
 注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
 法定代表人:杨杰
 办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
 联系人:张燕
 联系电话:010-58325388*1588
 网站:www.new-land.com.cn
 客服电话:400-166-1188
 100. 上海陆金所基金销售有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 法定代表人:王之光
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 联系人:宁博宇
 客服电话:4008219031
 网站:www.lufunds.com
 101. 上海联石财富基金销售有限公司
 注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号902-115室
 法定代表人:陈海武
 客服电话:400-643-3389
 联系人:葛佳慧
 电话:021-63333319
 传真:021-63332523
 网站:www.visionwealth.com
 102. 北京恒天明泽基金销售有限公司
 注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
 办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO盛盛中心30层3001室
 法定代表人:周斌
 客服电话:4008890618
 网站:www.chtfund.com
 103. 上海长盈基金销售有限公司
 办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
 法定代表人:张怀涛
 客服电话:4008202899
 联系人:邵晓芳
 电话:021-20691931
 传真:021-20691861
 网站:www.eichfund.com
 104. 深圳众禄基金销售有限公司
 注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼8001
 法定代表人:曹峰
 联系人:童彩平
 电话:0755-33227950
 传真:0755-82080798
 网址:www.zlzfund.com
 客服电话:4006-788-587
 105. 上海利得基金销售有限公司
 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
 办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢4楼
 法定代表人:李兴春
 传真:021-50683633
 电话:021-50683633
 客服电话:400-921-7755
 网站:www.laifund.com.cn
 106. 珠海盈米基金销售有限公司
 注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491法定代表人:肖雯
 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12楼B1201-1203
 联系人:黄敏娟
 网站:www.yingmi.com
 客服电话:020-89620066
 107. 南京苏宁基金销售有限公司
 注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
 办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
 法定代表人:王峰
 客服电话:95177
 108. 上海壹财基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
 法定代表人:毛伟平
 办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦8层
 客服热线:400-817-5666
 公司网站:www.yicai.com.cn
 109. 北京展恒基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区阜成路1号1号院6号楼2单元21层222507
 法定代表人:闫斐斐
 客服电话:4000618918
 联系人:袁永娟
 电话:010-61840698
 传真:010-61840699
 网站:https://danjuanapp.com
 110. 北京特瑞基金销售有限公司
 注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
 办公地址:北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部
 法定代表人:江卉
 电话:个人业务:95118, 400 098 8511
 企业业务:400 088 8816
 传真:010-89196566
 网站:fund123.com
 111. 嘉实财富管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
 法定代表人:赵学军
 电话:010-65215588
 传真:010-85712195
 联系人:李雯
 联系人邮箱:liwen@harvestwm.cn
 客服电话:400-021-8850
 网站:www.harvestwm.cn
 112. 上海基煜基金销售有限公司
 住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
 办公地址:上海市杨浦区昆明路518号a1002室
 法定代表人:王瑞
 联系人:安彬
 客服电话:400-820-5369
 网站:www.jiyufund.com
 113. 上海万得基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4楼层449室
 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906
 法定代表人:杨文斌
 客服电话:400-700-9666
 联系人:张磊
 电话:021-58970011
 传真:021-68596916
 网站:www.ehowbuy.com
 114. 北京百度百盈基金销售有限公司
 注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
 办公地址:北京市海淀区中关村大街甲9号智科大厦
 法人代表:张磊
 公告联系人:杨琳
 公告电话:010-61967202
 公告传真:010-61961007
 客服电话:95055-9
 网址:www.baiyingfund.com
 115. 上海天天基金销售有限公司
 注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座南楼
 法人代表:其实
 联系人:潘世友
 电话:021-54509988
 电话:021-64383798
 客服电话:400-1818-188
 网站:www.1234567.com.cn
 116. 上海联泰基金销售有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福泰北路277号3层310室
 办公地址:上海市市长宁区福泉路518号B座3层
 邮编:200335
 法定代表人:燕斌
 联系人:兰敏
 电话:021-52822063
 电话:021-52872720
 客服电话:400-166-6788
 网站:www.66zichan.com
 117. 美丰基金销售有限公司
 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
 办公地址:深圳市南山区海德三路航天科发广场A座17楼1704室
 法定代表人:TWO WISE HOWE
 联系人:叶健
 电话:0755-89460507
 传真:0755-21674453
 客服电话:400-694-0500
 网站:www.meifund.com
 三、场内代销机构
 场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格,经上海证券交易所和中国证券

记结算有限责任公司认可的,可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转让等业务的上海证券交易所会员,名称详见上海证券交易所网站。

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二) 登记结算机构
 名称:中国证券登记结算有限责任公司
 注册地址:上海市浦东新区太平桥大街17号
 法定代表人:周明
 联系人:赵亦舒
 电话:(010) 50938782
 联系电话:(010) 50938007
 传真:(0756-83217421
 客服电话:400-980-9826
 注册地址:上海市浦东新区南汇路25号上海证券大厦南楼21楼
 办公地址:上海市浦东新区南汇路25号上海证券大厦南楼21楼
 经办律师:秦晓枫、傅晓
 电话:(021-68811680)
 传真:(021-68816880)

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
 会计师事务所名称:通力律师事务所
 注册地址:上海市浦东新区25号上海证券大厦南楼21楼
 办公地址:上海市浦东新区东长街1号东方广场安永大楼17层01-12室
 执行事务合伙人:吴建平
 电话:(010) 581813000, (0756) 2502828
 其他应付款:(010) 58182828, (0756) 250261788
 签字注册会计师:昌华、高鹤
 联系人:昌华
 四、基金的名称
 大成沪深300指数证券投资基金

五、基金类别
 股票型指数基金
 六、基金的投资方式
 契约型开放式
 七、基金的投资目标
 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

八、基金的投资范围
 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300 指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券等不低于基金资产净值5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生品市场推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生品进行风险管理。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金资产净值的90%。除非法律法规另有规定,本基金的投资资产比例以提高到基金资产净值的100%。

九、基金投资策略
 本基金采用被动式指数基金投资策略。原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来复制、复制标的指数,并原则上根据标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果造成可能带来的影响,或因某些特殊情况(如股权分置改革等)导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生品进行风险管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

十、基金的风险收益特征
 本基金的风险收益特征,是风险中等、获得证券市场平均收益率的资产。

十一、基金的风险收益特征
 本基金为指数基金,是风险中等、获得证券市场平均收益率的资产。

十二、基金投资组合报告
 基金管理人的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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2019年4月11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2018年12月31日,本报告中列示财务数据已经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况
 序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
 1 权益投资 1,499,761,358.10 93.67
 其中:股票 1,499,761,358.10 93.67
 2 基金投资 - -
 3 固定收益投资 80,200,000.00 5.01
 其中:债券 80,200,000.00 5.01
 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 17,300,346.26 1.08
 8 其他各项资产 3,531,646.21 0.24
 9 合计 1,601,083,348.56 100.00

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境内股票投资组合
 代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
 A 农林牧渔 2,993,298.76 0.18
 B 采矿业 55,560,823.80 3.36
 C 制造业 606,636,047.53 37.66
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 47,277,068.80 2.96
 E 建筑业 57,505,062.16 3.60
 F 批发和零售业 33,946,246.60 2.12
 G 交通运输、仓储和邮政业 54,095,040.60 3.38
 H 住宿和餐饮业 - -
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 17,309,133.50 1.09
 J 金融业 486,162,996.01 29.16
 K 房地产业 70,229,595.68 4.39
 L 租赁和商务服务业 22,444,808.18 1.40
 M 科学研究和技术服务业 1,572,060.00 0.10
 N 水利、环境和公共设施管理业 4,413,198.26 0.28
 O 居民服务、修理和其他服务业 - -
 P 教育 - -
 Q 卫生和社会工作 - -
 R 文化、体育和娱乐业 - -
 S 综合 9,309,249.91 0.59
 合计 1,494,369,653.18 92.68

(2) 期末港股投资按行业分类的境内股票投资组合
 代码 行业名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)
 A 农林牧渔 业 - -
 B 采矿业 - -
 C 制造业 2,326,839.19 0.15
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -
 E 建筑业 - -
 F 批发和零售业 - -
 G 交通运输、仓储和邮政业 - -
 H 住宿和餐饮业 - -
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -
 J 金融业 50,145.80 -
 K 房地产业 3,014,719.03 0.19
 L 租赁和商务服务业 - -
 M 科学研究和技术服务业 - -
 N 水利、环境和公共设施管理业 - -
 O 居民服务、修理和其他服务业 - -
 P 教育 - -
 Q 卫生和社会工作 - -
 R 文化、体育和娱乐业 - -
 S 综合 - -
 合计 5,391,704.92 0.34

(3) 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
 代码 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
 A 农林牧渔 业 - -
 B 采矿业 - -
 C 制造业 2,326,839.19 0.15
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -
 E 建筑业 - -
 F 批发和零售业 - -
 G 交通运输、仓储和邮政业 - -
 H 住宿和餐饮业 - -
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -
 J 金融业 50,145.80 -
 K 房地产业 3,014,719.03 0.19
 L 租赁和商务服务业 - -
 M 科学研究和技术服务业 - -
 N 水利、环境和公共设施管理业 - -
 O 居民服务、修理和其他服务业 - -
 P 教育 - -
 Q 卫生和社会工作 - -
 R 文化、体育和娱乐业 - -
 S 综合 - -
 合计 5,391,704.92 0.34

(4) 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 000139 中信证券 1,181,231 66,272,108.10 4.15
 2 000405 中钢集团 152,493 30,971,204.95 1.94
 3 001328 交通银行 5,315,608 30,777,370.32 1.92
 4 600036 招商银行 1,070,942 26,987,738.40 1.69
 5 601988 中国银行 7,383,140 26,580,928.40 1.66
 6 000661 格力电器 621,689 22,196,218.41 1.39
 7 000533 美的集团 652,408 21,467,168.88 1.34
 8 601166 兴业银行 1,336,715 19,709,522.10 1.25
 9 600016 民生银行 3,467,072 19,386,522.54 1.24
 10 000046 深赛格 154,544 17,051,088.72 1.06

(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 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
 1 180404 18沃旭4 800,000 80,200,000.00 5.02
 2 180405 18沃旭5 267,564 2,220,115.48 0.14
 3 001316 上海教育 1,346 66,039.60 0.00
 4 601980 华泰证券 15,370 65,146.80 0.00
 5 603929 爱康医疗 1,061 40,694.21 0.00

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
 7. 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
 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
 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 11. 投资组合报告附注
 (1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形
 1. 本基金投资的前十名证券之一兴业银行(601166.SH)的发行主体兴业银行股份有限公司于2018

年4月19日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕1号)。兴业银行作为本基金跟踪标的指数的成份股。

2. 本基金投资的前十名证券之一交通银行(601328.SH)的发行主体交通银行股份有限公司于2018年7月26日因未按规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字〔2018〕1号)。于2018年11月因因不良信贷资产未清转让,理财资金投资于不良信贷资产收益权等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕12号、银保监银罚决字〔2018〕13号)。交通银行作为本基金跟踪标的指数的成份股。

3. 本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036.SH)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕1号)。招商银行作为本基金跟踪标的指数的成份股。

4. 本基金投资的前十名证券之一民生银行(600166.SH)的发行主体中国民生银行股份有限公司于2018年1月9日因信贷资产未清转让违反审慎经营规则等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字〔2018〕1号、银保监银罚决字〔2018〕18号)。民生银行作为本基金跟踪标的指数的成份股。

(2) 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
 (3) 报告期末其他各项资产构成
 单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	122,998.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,690,184.16
5	其他应收款	1,008,464.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,831,646.21

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
 (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 1. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。
 2. 期末非指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	3,014,719.03		