

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二〇一九年十二月

重要提示

大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2015年3月26日证监许可【2015】450号文予以注册。基金合同于2015年6月5日正式生效。

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出的任何决定,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明其对基金投资有推荐意见。

本更新招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同及约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金投资运作流程,可以详见基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读招募说明书。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2019年6月5日(其中人员变动信息以公告日为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2019年3月31日,所列财务数据未经审计。

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月21日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为华泰信托有限责任公司(持股比例95%)、中国银河投资管理有限责任公司(持股比例2%)、光大证券股份有限公司(持股比例3%)三家公司。
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83195688
联系人:肖剑

二、基金托管人
名称:中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人:周慕冰
电话:010-66060069
传真:010-66121816

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点及员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营,可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“特色鲜明、服务精准、机制灵活、运行高效”的现代金融服务平台,推出多品牌、多元化的金融产品,致力为“本”客户群体提供优质的金融服务,为广大客户创造价值,共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被评为《全球托管人》“最佳托管银行”,2007年中国银行业银行通过了美国AS70内部风险控制审计,并获得无保留意见的AS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA63402)认证,表明独立第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金牌理财”TOP10颁奖盛典”中连续突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳托管银行”奖。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳托管银行”称号,2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和《中国货币》杂志清算有限责任公司授予的“优秀托管机构”称号,2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号,2018年荣获《中国基金报》主办的公募基金20年“最佳托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国银行批准成立,2014年更名托管部,养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户二部、客户一部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息管理部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控合规部,现有员工240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和

高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。
三、基金托管业务经营情况
截止至2019年3月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共440只。

(二)基金托管人的内部控制制度说明
1、内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监督,确保基金财产的安全完整,确保有关信息的准确、完整、及时、保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构
风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理,并制定托管业务的风险管理政策和程序。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施
具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印控流程保管、存放、使用,账户开通、资金划拨、划款指令,业务操作程序等有专门设置,内部控制管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运用基金投资的方法和程序
基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人指令等监督基金管理人是否遵守基金合同。
当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况采取以下方式的处置:
1、电话提示:对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
2、书面警示:对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行警示;
3、书面报告:对投资比例超标、清算资金透支以及与其涉嫌违规关联交易等,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

四、相关服务机构
(一)销售机构及联系人
一、直销机构
大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83195688
联系人:姜成

大成基金客户服务热线:400-888-5558(免长途话费)
大成基金深圳投资理财中心
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人:吴海英、关志玲、白小雪
电话:0755-22223564/22222171/22223555
传真:0755-83192525/83195242/83195232
邮编:518040

二、场外代销机构
1、中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
法定代表人:张佑君
客服电话:010-84868888
联系人:顾薇
电话:010-60636096
传真:010-84868660
网址:www.cs.citic.com

2、海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
客服电话:95553,400-888-8001
联系人:李奕鸣
电话:021-23219000
传真:021-63607222
网址:www.htsec.com

3、东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:上海市东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:宋科
客服电话:95531
联系人:梁旭
电话:021-20333333
传真:021-50498825
网址:www.longone.com.cn

4、中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街50号国际企业大厦C座
法定代表人:宋广利
客服电话:4008-888-888
联系人:宋明
联系电话:010-66584850
传真:010-66586900
网址:www.chinastock.com.cn

5、中信证券(上海)有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号40层
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:杨宝林
客服电话:95548
联系人:吴忠超
电话:0532-86022326
传真:0532-86022605
网址:www.czw.com.cn

6、申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号40层
办公地址:上海市徐汇区区长乐路989号40层
法定代表人:李巍
客服电话:95523或4008895523
联系人:曹茜
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.swyw.com

7、光大证券股份有限公司
办公地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:薛峰
客服电话:400-888-8788,95525
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com

8、国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
客服电话:95536
联系人:李慧
电话:0755-82130377
传真:0755-82130333
网址:www.guosen.com.cn

9、中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权鹏
电话:010-85130577
传真:010-65185228
网址:www.cbsc.com.cn

10、招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:肖小东
客服电话:95565
联系人:黄婵娟
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
网址:www.newchina.com.cn

11、东方财富证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号新源广场2号楼22-29楼
法定代表人:潘鑫军
客服电话:956503
联系人:胡月娟
电话:021-63232888
传真:021-63236173
网址:www.dfzq.com.cn

12、华西证券股份有限公司
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:杨炯华
客服电话:4008888818
联系人:金达明
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
网址:www.hx168.com.cn

13、国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
客服电话:95521
联系人:芮筱娟
电话:022-28451991
传真:022-28451982
客服电话:4008515888
网址:www.guotai.com.cn

14、申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005
联系人:李莉
电话:010-88085858
传真:010-88085195
联系人:李巍
客服电话:400-800-0662
网址:www.hysec.com

15、渤海证券股份有限公司
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:李海荣
电话:022-28451991
传真:022-28451982
客服电话:4008515888
网址:www.bhsc.com.cn

16、西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆
联系人:余维佳
客服电话:400806096
联系人:张兴
电话:023-63786633

网址:www.swsc.com.cn
18、上海证券有限责任公司
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:许曼华
电话:021-53619888
传真:021-63008330
网址:www.962518.com

基金管理人可根据有关法律、法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构,并及时公告。
三、场内代销机构
指具有基金代销业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

(二)登记结算机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:刘诚
联系人:赵亦舒
电话:(010)50938782
传真:(010)50938807

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:沈娜、冯艾
联系人:冯艾

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238888
传真:021-23238900
联系人:陈薇薇
经办注册会计师:张振波、陈薇薇

四、基金的投资
大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金
股票投资组合基准
六、基金的投资方式
七、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的最小化。

八、基金的投资范围
本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股。
为了更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括中、小盘、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中期票据)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融品种(但须符合中国证监会的相关规定)。

九、基金的投资策略
本基金采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
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,或因基金申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或对标的指数成分股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调整,以期紧密跟踪或超越标的指数。
本基金投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融品种,如权证以及其与标的指数的股指期货成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将遵循投资的原则,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

在正常市场条件下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差率不超过2%。如标的指数跟踪偏离度和跟踪误差的其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

十、决策程序
1、投资决策
本基金实行投资决策委员会领导下的基金投资管理制,投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的对标决策,其他重大调整决策以及重大的单项投资决策;基金投资决策日常决策由基金经理在组合构建、调整决策以及每日申购、赎回申购单的编制执行。

2、投资管理体制
本基金实行投资决策委员会领导下的基金投资管理制,投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的对标决策,其他重大调整决策以及重大的单项投资决策;基金投资决策日常决策由基金经理在组合构建、调整决策以及每日申购、赎回申购单的编制执行。

3、投资程序
研究支持、投资管理、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护的有机结合共同构成了本基金投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资目标的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究支持:数量投资部依托公司整体平台,整合内外部信息与券商等外部研究力量,开展研究数据跟踪,成份股行业行为等相关信息收集与分析,流动性分析、跟踪误差及归因分析等工作,作为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,每日进行基金投资组合的日常调整。

(3)组合构建:根据标的指数成份股,结合研究支持,基金管理人以完全复制标的指数成份股及权重构建投资组合,在追求实现基金投资目标的前提下,基金管理人将采取适当的方法,以降低仓位偏差、控制跟踪误差。
(4)交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,同时执行一线监控的职责。
(5)跟踪绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了预期投资目标,组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否,基金管理人将以此检讨投资策略,进而调整投资组合。
(6)组合监控与调整:基金管理人跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、成份股行业行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等,采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数的变动。

基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下,将根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整,并在更新的招募说明书中公告。
十、基金的投资比较基准
本基金的业绩比较基准为标的指数。
如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在按照适当程序要求履行适当程序后变更本基金的标的指数,以确保本基金的投资目标,若变更标的指数,则本基金的投资目标和投资策略均无实质性调整(包括但不限于编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致,报中国证监会备案并发布公告,变更后本基金业绩比较基准,标的指数涉及本基金投资组合或投资标的变更,则本基金管理人应履行变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。

十一、基金的风险收益特征
本基金为股票型指数基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险与预期收益高于混合基金、债券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。
十二、基金的投资风险提示
基金管理人的董事会及董事承诺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。
基金托管人中国农业银行根据基金合同规定,于2019年6月18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2019年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
(一) 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	264,426,386.25	98.69
2	其中:股票	264,426,386.25	98.69
3	债券投资	-	-
4	基金投资	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和拆出资金	-	-
9	其他	-	-
10	合计	268,218,900.37	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	8,392,494.09	3.13
B	采矿业	1,389,180.09	0.70
C	制造业	165,738,650.07	61.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,381,025.01	1.07
E	建筑业	2,096,316.88	0.78
F	批发和零售业	6,043,198.37	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	2,524,484.96	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,038,056.26	10.12
J	金融业	18,228,371.21	6.81
K	房地产业	14,227,927.56	5.31
L	租赁和商务服务业	3,732,828.78	1.39
M	科学研究和技术服务业	1,080,397.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	1,898,519.28	0.71
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	3,621,422.54	1.43
R	文化、体育和娱乐业	5,094,240.29	1.91
S	综合	497,613.69	0.19
合计		264,036,026.48	98.64

(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,825.85	0.04
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	154,300.00	0.06
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	32,902.94	0.01
J	金融业	134,340.00	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	科学研究和技术服务业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		429,379.79	0.16

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
(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明细

(1) 报告期末指数投资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	000051	格力电器	104,500	8,710,285.00	3.25
2	000333	润兴股份	177,750	8,861,707.50	3.28
3	000668	五粮液	70,700	6,946,200.00	2.61
4	300498	蓝晓科技	146,404	5,149,020.40	2.22
5	000002	万科A	163,600	6,022,720.00	1.88
6	002415	海康威视	135,226	4,742,340.76	1.77
7	000001	平安银行	323,600	4,147,270.00	1.56
8	000725	京东方A	1,000,100	3,900,300.00	1.46
9	300669	东方财富	150,067	2,575,740.48	1.09
10	002394	汉邦高科	21,560	2,032,116.04	1.04

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002987	耀华新材	4,400	154,200.00	0.06
2	002668	奇安信	17,700	134,340.00	0.06
3	300762	上海瀚讯	1,233	82,477.03	0.03
4	300796	华昌达	1,103	32,492.94	0.01
5	000562	亚太药业	514	26,350.48	0.01

(四) 报告期末按资产分类的债券投资组合
注:本基金报告期末未持有债券。
(五) 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明细
注:本基金报告期末未持有债券。
(六) 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。
(七) 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投资。
(八) 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。
(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。
(2) 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的成交成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。
(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1) 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。
(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资国债期货。
(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
(十一) 投资组合报告附注
(1) 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体未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) 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	2,309.07
2	应收申购款	131,046.18
3	应收利息	-
4	应收股利	736.73
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他资产	-
9	合计	134,090.98

4、报告期末基金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) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
(2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

6、由于前四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
十三、基金业绩
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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
(一) 自基金合同生效日以来完整会计年度的