

## Disclosure

## 南方沪深 300 指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(上接 17 版)

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼  
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼  
法定代表人:杨宇翔  
联系人:袁月  
电话:0755-22627802  
客户服务电话:956111  
网址:pingan.com.cn

(34) 国海证券有限责任公司  
注册地址:广西南宁市滨湖路 46 号  
办公地址:广西南宁市滨湖路 46 号  
法定代表人:张雅锋  
联系人:覃静芳  
联系电话:(0771) 5539262  
客户服务电话:400888100(全国)、96100(广西)  
网址:http://www.gbzq.com.cn  
(35) 中国建银投资证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层  
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层  
法定代表人:杨小阳  
联系人:刘钊  
电话:0755-82026521  
传真:0755-82026539  
网址:www.cbjs.com  
(36) 江南证券有限责任公司  
法定代表人:姚江涛  
地址:江西省南昌市抚河北路 291 号  
邮政编码:330008  
联系人:余鑫娜  
联系电话:0791-6768763  
传真电话:0791-6789414  
客服电话:0791-6768763  
公司网址:http://www.jsstock.com.cn

(37) 瑞银证券有限责任公司  
注册地址:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层  
办公地址:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层  
法定代表人:刘弘  
联系人:谢亚文、韩晓光  
联系电话:010-59226788  
传真:010-59226840  
客服电话:400-887-8827  
网址:www.ussecurities.com

(38) 德邦证券股份有限公司  
注册地址:上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼  
办公地址:上海市福州路 500 号城建大厦 26 楼  
法定代表人:方加春  
电话:021-68761616  
传真:021-68767981  
业务联系人:罗芳  
客服电话:4008888128  
公司网站:www.tebon.com.cn

(39) 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 22-25 层  
办公地址:重庆市渝中区临江路 2 号合景国际大厦 22-25 层  
法定代表人:范剑  
联系人:杨卓颖  
电话:023-63786397  
网址:www.swsc.com.cn  
(40) 大通证券股份有限公司  
注册地址:杭州市解放路 111 号钱业大厦  
办公地址:杭州市解放路 111 号钱业大厦  
法定代表人:沈继宁  
联系人:乔骏  
电话:0671-87925129  
客户服务电话:0671-96336(上海地区;962336)  
网址:www.dtscc.com.cn

(41) 方正证券有限责任公司  
注册地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华信国际大厦 22-24 层  
办公地址:湖南长沙芙蓉中路 2 段华信国际大厦 22-24 层  
法定代表人:雷杰  
联系人:邢杰  
开放式基金咨询电话:95571  
开放式基金业务传真:0731-2892332  
公司网站:http://www.foundsec.com.cn  
(42) 国盛证券有限责任公司  
注册地址:江西省南昌市永叔路 15 号  
办公地址:江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼  
法定代表人:管荣升  
联系电话:0791-6289771  
联系人:徐美云  
公司网站:www.gssstock.com

(43) 华安证券股份有限公司  
注册地址:安徽省合肥市长江路 357 号  
办公地址:安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦  
法定代表人:李工  
联系人:唐冰  
电话:0651-5161671  
客户服务电话:0651-96518/4008096618  
网址:www.hazq.com  
(44) 大同证券经纪有限责任公司  
法定代表人:董祥  
联系人:苏妮  
邮政编码:030001  
联系电话:0351-4167056  
传真:0351-4192803  
网址:www.dtsbc.com.cn  
(45) 华林证券有限责任公司  
地址:珠海市拱北夏湾华平路 96 号 2 层 202-203 房  
法定代表人:段文涛  
联系人:杨玲  
联系电话:0756-83749624  
客服电话:0756-82707866  
公司网址:www.chinalions.com  
(46) 新时代证券有限责任公司  
注册地址:北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 15 层  
办公地址:北京市西城区金融街 1 号 A 座 8 层  
法定代表人:马金声  
联系人:朱雪雁  
电话:010-83661165  
传真:010-83661164  
公司网站:www.xsdzq.cn  
(47) 上海证券有限责任公司  
注册地址:上海市西藏中路 336 号  
法定代表人:蒋元先  
联系电话:021-51539888  
联系人:邵秀峰  
公司网址:http://www.962518.com  
客服电话:021-962518

(48) 民生证券股份有限公司  
注册地址:北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室  
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室  
法定代表人:岳献春  
联系电话:010-85252656  
传真电话:010-85252655  
联系人:赵明  
客服热线:4006198888  
公司网址:www.mszzq.com

(49) 东方证券股份有限公司  
注册地址:上海浦东大道 720 号 20 楼  
法定代表人:王益民  
联系电话:021-68662200-3019  
客服热线:021-962506  
联系人:盛云  
公司网址:www.dfzq.com.cn  
(50) 宏源证券股份有限公司  
注册地址:新疆乌鲁木齐文艺路 233 号  
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 D 座  
联系人:李巍  
电话:010-62294608-6460  
客服电话:4008-000-562  
公司网址:www.hysec.com  
(51) 安信证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
法定代表人:牛冠兴  
联系人:余江  
开放式基金咨询电话:400801001、020-96210

联系电话:0755-8258323  
网址:www.essence.com.cn  
(52) 东海证券有限责任公司  
注册地址:江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼  
办公地址:江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18 楼  
法定代表人:朱科敏  
联系人:李涛  
公司网址:http://www.longone.com.cn  
客服电话:0619-88166222、021-62574650、0379-64902266  
免费服务热线:400-888-8588

(53) 西部证券股份有限公司  
住所:西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层  
办公地址:西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层  
法定代表人:刘建武  
电话:029-87406488  
传真:029-87406387  
联系人:冯萍  
网址:www.westsec.com.cn  
客户服务电话:029-96708  
(54) 财富证券有限责任公司  
注册地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼  
办公地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼  
法定代表人:周晖  
联系人:郭磊  
客户咨询电话:0731-4403360  
网址:www.cfzq.com.cn  
(55) 恒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  
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号  
法定代表人:刘改军  
电话:0471-4913908  
传真:0471-4930707  
联系人:常向东  
客户服务电话:0471-4961259  
网址:www.cnhl.com.cn

(56) 万联证券有限责任公司  
注册地址:广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层  
办公地址:广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层  
法人代表:李劲金  
联系人:罗创斌  
联系电话:020-37965070  
客服电话:400-8888-133  
网址:www.wljz.com.cn  
(57) 国元证券股份有限公司  
注册地址:安徽省合肥市寿春路 179 号  
法定代表人:吴国志  
电话:0651-2634400  
传真:0651-2645709  
网址:www.gyzq.com.cn  
公司办公地址:安徽省合肥市寿春路 179 号  
邮政编码:230001

(58) 金元证券股份有限公司  
注册地址:海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层  
办公地址:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 4 层  
法定代表人:陆涛  
电话:0756-83026895  
传真:0756-83026252  
联系人:金春  
客服电话:4008-888-228  
网址:www.jyzq.com.cn  
(59) 浙商证券有限责任公司  
地址:浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼  
法定代表人:吴根  
电话:0671-87901963  
联系人:吴颖  
客户咨询电话:0671-87902079  
网址:www.stocke.com  
(60) 中国国际金融有限公司  
注册地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层  
办公地址:北京市建国门外大街 6 号 SK 大厦  
法定代表人:李剑阁  
联系人:王雪剑  
电话:010-85679265  
传真:010-85679635  
客户服务电话:(010)85679238 (010)85679169  
网址:www.cicc.com.cn

(61) 华泰证券经纪有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行大厦 18 楼  
办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行大厦 18 楼  
法定代表人:高源  
电话:0756-83706865  
传真:0756-83704195  
客户服务热线:0756-83710885  
公司网站:www.ytjq.net  
(62) 华鑫证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区深南东路 5046 号深业大厦 25 层 2512、2513  
办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01  
法定代表人:王文学  
联系人:杨小川  
联系电话:0755-82083788  
传真:0755-82083408  
客服热线:021-62163333、029-68918888  
网址:www.cfsc.com.cn  
(63) 世纪证券有限责任公司  
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层  
法人代表:强毅  
联系人:刘军辉  
电话:0756-83199511  
公司网址:www.csco.com.cn  
(64) 华宝证券经纪有限责任公司  
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 楼  
法定代表人:陈林  
联系人:严俊权  
联系电话:021-50122222  
传真:021-50122200  
客户服务专线:400-820-9898  
公司网址:www.cnhbstock.com

(65) 华龙证券有限责任公司  
办公地址:甘肃省兰州市静宁路 308 号  
法定代表人:李晓安  
电话:(0931) 8880888  
传真:(0931) 4890615  
联系人:李昕田  
客户服务热线:(0931) 4890619、4890616、4890100  
网址:www.hlzqsc.com  
(66) 日信证券有限责任公司  
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路 18 号  
办公地址:北京市西城区南中街大街 1 号兴安金融中心西座 11 层  
法定代表人:洪明  
联系人:张明  
电话:010-89098830  
网址:www.rxzq.com.cn  
(67) 国金证券股份有限公司  
公司注册地址:成都市东城根上街 95 号  
公司办公地址:成都市东城根上街 95 号  
法定代表人:雷波  
联系人:王丹  
联系电话:028-86690125  
传真:028-86690126  
网址:www.gjzq.com.cn  
客服电话:028-95105111  
(68) 江海证券有限公司  
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  
法定代表人:孙名扬  
联系人:徐世旺  
电话:0451-82338963  
传真:0451-82287211  
客户服务电话:400-666-2288  
网址:www.jhzq.com.cn  
(69) 信达证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区三里河东路 5 号中农大厦 10 层  
办公地址:北京市西城区三里河东路 5 号中农大厦 10 层  
法定代表人:张志刚  
联系人:唐静  
联系电话:010-88665100  
传真:010-88666290  
客户服务热线:400-800-8899  
公司网站:www.cindasc.com  
(70) 天相投资顾问有限公司  
注册地址:北京市西城区金融街 19 号富都大厦 B 座 701  
办公地址:北京市西城区金融大街 5 号新大厦 B 座 4 层  
法定代表人:林义相  
客服热线:(010) 66045678  
传真:(010) 66045600  
联系人:莫晓璐  
联系电话:(010) 66045529  
公司网站:www.txsec.com、www.txjijin.com

(71) 其他具有开放式基金代销资格的证券公司请向当地营业网点查询  
(72) 注册登记机构  
南方基金管理有限公司  
注册地址:深圳市福田区中心区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31、32、33 楼层整层  
法定代表人:吴万善  
电话:(0755) 182763848  
传真:(0755) 182763888

联系人:代庆红  
(三) 律师事务所和经办律师  
名称:广东华瀚律师事务所  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路 1002 号宝安广场 A 座 16 楼 G.H 室  
负责人:李兆良  
电话:(0755)82687860  
传真:(0755)82687861  
经办律师:杨忠、戴瑞冬

(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有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室  
办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
法定代表人:杨绍辉  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238800  
联系人:单峰  
经办注册会计师:薛莹、单峰

#### 四、基金的名称

南方沪深 300 指数证券投资基金

#### 五、基金的类别

股票型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和量化的风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过 0.3%, 年跟踪误差不超过 4%,以实现沪深 300 指数的有效跟踪。

#### 七、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选股成份、新股(一级市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,沪深 300 指数的成份股及其备选股成份的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

此外,本基金每日可投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具,待指数衍生金融产品推出以后,基金管理人可以履行适当程序使本基金运用衍生金融产品进行风险管理。

#### 八、基金的投资策略

本基金为完全被动式指数投资基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或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投资管理,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

#### (一) 资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于沪深 300 指数成份股和备选股成份。原则上本基金将采用指数复制法,按标的指数的成份股权重构建组合,少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

#### (二) 股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据沪深 300 指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

##### 1. 股票投资组合的构建

本基金在建仓初期,将按照沪深 300 指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的成份股即调整或其他影响因素制约的因素时,本基金可以根据市场环境,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

##### 2. 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,本基金还将根据法律法规及基金合同约定限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,力争基金净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最小化。此外需要指出的是,基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,此时也需要寻求替代。

##### (1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的沪深 300 指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

##### (2) 不定期调整

① 当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司公告的股权变动公告次日发布的临时调整决定及其需调整的股权比例,进行相应调整;

② 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

③ 若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素,使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

##### (三) 债券投资策略

本基金债券投资策略将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择,同时着重考虑基金的流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

##### (四) 金融衍生品投资策略

本基金采用市场公认的定价技术,适当参与金融衍生产品的投资,以实现以下目的:

1. 对某些成份股的特殊突发风险和其他特殊情况下的流动性风险;

2. 适当利用金融衍生产品组合的持有收益进一步锁定基金固定费用;

利用金融衍生产品的杠杆作用,减少现金及债券对跟踪指数的拖累。

#### 九、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同开发的中国 A 股市场指数,它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数,流动性高,可投资性强,综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况,其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用,能够作为基金业绩的标杆的指数。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布,或沪深 300 指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数或证券市场上有其他代表性更强、更适合作为投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的标的指数和业绩比较基准,并依循市场通行、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数和业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准,不需召开基金份额持有人大会通过,但应经托管人同意及报中国证监会核准,并在中国证监会指定的媒体上公告。

#### 十、基金的风险控制特征

本基金属股票型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数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。

十一、基金的投资组合报告(如无特别说明以下单位均为元)

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本基金合同规定,于 2009 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务资料、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理或运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本投资组合报告所载数据截至 2009 年 9 月 30 日。

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              | 1,797,771,049.88 | 94.37        |
|    | 其中:股票             | 1,797,771,049.88 | 94.37        |
| 2  | 固定收益投资            | -                | -            |
|    | 其中:债券             | -                | -            |
| 3  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 4  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 98,410,447.41    | 5.17         |
| 6  | 其他资产              | 8,791,792.86     | 0.46         |
| 7  | 合计                | 1,904,973,290.27 | 100.00       |

2、报告期末未按行业分类的股票投资组合

| 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    | 7,211,844.00     | 0.29         |
| B  | 采矿业         | 296,204,163.47   | 10.89        |
| C  | 制造业         | 525,097,473.67   | 27.71        |
| CO | 食品饮料        | 68,544,724.96    | 3.62         |
| C1 | 纺织服装、皮毛     | 9,472,615.00     | 0.50         |
| C2 | 轻工、文具       | -                | -            |
| C3 | 医药生物        | 6,346,528.20     | 0.34         |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 47,182,181.76    | 2.52         |
| C5 | 电子          | 8,311,250.00     | 0.44         |
| C6 | 金属、非金属      | 166,960,041.87   | 8.81         |
| C7 | 机械、设备、仪器    | 158,335,042.79   | 8.37         |
| C8 | 医药、生物制品     | 48,344,725.35    | 2.55         |
| C9 | 计算机设备       | 10,705,464.72    | 0.56         |
| D  | 建筑业         | 66,488,298.98    | 3.19         |
| E  | 交通运输        | 39,398,898.80    | 2.08         |
| F  | 交通运输、仓储     | 84,774,891.35    | 4.47         |
| G  | 信息技术        | 56,138,967.00    | 2.96         |
| H  | 批发和零售贸易     | 54,982,907.60    | 2.90         |
| I  | 金融、房地产      | 580,355,387.19   | 30.63        |
| J  | 房地产业        | 112,230,956.84   | 5.92         |
| K  | 社会服务        | 29,133,524.25    | 1.54         |
| L  | 传播与文化产业     | 4,779,496.00     | 0.25         |
| M  | 综合类         | 86,974,021.27    | 4.15         |
|    | 合计          | 1,797,771,049.88 | 94.88        |

| 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  | 001328 | 招商银行 | 2,618,166 | 63,459,322.78 | 3.35         |
| 2  | 000036 | 中国银行 | 4,213,316 | 62,272,810.48 | 3.29         |
| 3  | 001318 | 中国平安 | 1,013,919 | 55,968,603.30 | 2.95         |
| 4  | 000014 | 民生银行 | 7,235,300 | 48,765,922.00 | 2.57         |
| 5  | 001166 | 招商银行 | 1,345,296 | 45,460,930.84 | 2.40         |
| 6  | 000030 | 中信证券 | 1,784,065 | 44,619,465.65 | 2.35         |
| 7  | 600000 | 浦发银行 | 2,152,660 | 41,996,750.00 | 2.21         |
| 8  | 000002 | 光大 A | 3,721,000 | 38,773,820.00 | 2.05         |
| 9  | 001088 | 中国银行 | 1,287,731 | 38,488,920.56 | 2.03         |
| 10 | 001169 | 民生银行 | 1,675,666 | 28,870,091.38 | 1.52         |

| 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                     | 中期票据       | -       | -            |
| 4                     | 企业债、资产支持证券 | -       | -            |
| 5                     | 公司债        | -       | -            |
| 6                     | 可转债        | -       | -            |
| 7                     | 其他         | -       | -            |
| 8                     | 合计         | -       | -            |

| 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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                                   | -    | -    | -     | -       | -            |
| 2                                   | -    | -    | -     | -       | -            |
| 3                                   | -    | -    | -     | -       | -            |
| 4                                   | -    | -    | -     | -       | -            |
| 5                                   | -    | -    | -     | -       | -            |

| 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 |      |      |       |         |              |
|---|------|------|-------|---------|--------------|
| 序号                                      | 证券代码 | 证券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1                                       | -    | -    | -     | -       | -            |
| 2                                       | -    | -    | -     | -       | -            |
| 3                                       | -    | -    | -     | -       | -            |
| 4                                       | -    | -    | -     | -       | -            |
| 5                                       | -    | -    | -     | -       | -            |

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

k1 本基金本期投资的前十名证券中没有在发行前经监管部门立案稽查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

k2 本基金本报告期无停牌股票,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 预付账款    | 886,273.86   |
| 2  | 应收证券清算款 | 256,005.63   |
| 3  | 应收利息    | 937,999.98   |
| 4  | 应收股利    | 19,652.86    |
| 5  | 应收申购款   | 6,691,870.65 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 8,791,792.86 |

8.4 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。

8.5 报告期末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不存在流通受限情况。

#### 十二、基金的费用

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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