

南方成份精选股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(上接22版)

经办律师:廖海、吕红
(四)会计师事务所和经办注册会计师
普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区东昌路668号
办公地址:上海湖南路202号普华永道中心11楼(邮编:200021)
法人代表:杨绍信
电话:(021)61238988
传真:(021)61238900
经办注册会计师:汪隽 张立纲
四、基金名称
南方成份精选股票型证券投资基金基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金在符合中国证监会一贯投资理念基础上,通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研

究,采取定量和定性相结合方法,精选成份股,寻找驱动型领先的上市公司,在控制风险的前提下追求获取超额收益。
七、基金的投资范围
本基金投资的标的物具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的上市股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票投资以沪深300成份股以及上市未满1年,但符合其他进入沪深300指数条件的新上市公司为投资范围。
本基金投资组合为:股票占基金资产的60%-95%,其中对驱动型增长行业的代表性企业行业领先成长企业股票的投资不低于股票投资比例的80%;现金、债券、货币市场工具以及权证等其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限,不需经基金份额持有人大会审议。

八、投资策略
1.资产配置策略
本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析方法,对证券市场当期的系统性风险以及可预期的未来预期市场水平、预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期进行

调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
2.股票投资策略
优先配置2-3个驱动型增长行业中的代表企业,投资比例占股票市值部分的30%±10%。此外选择其他行业中符合行业领先型的企业作为投资对象,这部分企业占股票市值部分的70%±10%。
具体界定如下:

(1)驱动型增长行业:指对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业/产业。
通过对中国宏观经济的把握,根据对上下游行业运行态势与利益分配等因素的观察,考量行业增长周期,以确定对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业/产业。从优选代表企业重点投资。
定量指标:
预期行业平均增长率超过GDP增长率2-3倍。
行业代表企业:
市场份额位居同行业上市企业的前3位。
营业收入和净利润增长率不低于同行业上市公司平均水平。

(2)行业领先型成长企业:强调处于企业成长生命周期的上升期,或面临重大的发展机遇,具备超常增长潜力的上市公司。
该类企业成长生命周期的上升期,或者对于行业的成长、发展或者整合能起到领导作用。同时,企业不是依赖粗放的外延式扩张,而是追求有效率的成长,体现为边际投资收益率高于股东必要回报率水平。
定量指标:
预期主营业务收入增长率或税前利润增长率超过20%。
净资产收益率应当高于股东必要投资回报率水平(以上市公司平均净资产收益率度量)PB<2,处于上市公司中的较低水平。

九、债券投资策略
本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债(包括可转换债)。本基金将在研判利率走势的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。在选择债券品种时,本基金重点分析债券发行人的信债品质,包括发行机构以及保证机构的偿债能力、财务结构与安全性,并根据不同期限品种的研究,构造收益曲线,采用久期(duration)模型构建最佳债券投资组合,降低利率风险;对可转债的投资,结合对股票走势的判断,发现其套利机会。
十、风险控制特征
本基金为股票型基金,属于风险收益比较高风险的品种。
十一、基金的投资组合报告(未经审计)

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根据本基金合同规定,于2008年6月15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,并于2008年6月20日出具了复核报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
二〇〇八年六月二十七日

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
南方成份精选股票型证券投资基金
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

本投资组合报告所载数据截至2008年3月31日。

(一)期末投资组合组合情况

| 项目 | 金额 | 占基金总资产比例 |
|--------------|------------------|----------|
| 股票 | 15,267,761.1746 | 73.62% |
| 债券 | 332,892.3365 | 1.61% |
| 银行存款及清算备付金合计 | 5,088,216.82632 | 24.54% |
| 其他资产 | 49,575.37441 | 0.23% |
| 资产总计 | 20,738,445.66469 | 100.00% |

(二)期末按行业分类的股票投资组合

| 行业分类 | 市值 | 占基金资产净值比例 |
|------------------|------------------|-----------|
| A 农、林、牧、渔业 | 138,694.89824 | 0.06% |
| B 采矿业 | 1,090,463.49932 | 5.31% |
| C 制造业 | 7,133,577.93854 | 34.76% |
| D 食品饮料 | 1,979,583.13920 | 9.65% |
| E 纺织服装、皮毛 | - | - |
| F 医药、生物制品 | 118,438.03600 | 0.58% |
| G 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,466,507.73284 | 12.02% |
| H 电子 | 111,172.26400 | 0.54% |
| I 金属、非金属 | 1,009,369.42928 | 4.92% |
| J 机械、设备、仪表 | 1,378,976.05442 | 6.71% |
| K 医药、生物制品 | 70,532.29630 | 0.34% |
| L 其他制造业 | - | - |
| M 电力、煤炭、水的生产和供应业 | 201,401,860.600 | 0.98% |
| N 建筑业 | 487,163,781.390 | 2.36% |
| P 交通运输、仓储业 | 219,954,100.33 | 1.07% |
| Q 信息技术业 | 828,107,344.46 | 4.04% |
| R 批发和零售业 | 263,167,343.26 | 1.28% |
| T 金融、保险业 | 3,263,888,320.76 | 15.90% |
| X 其他服务业 | 1,413,823.0513 | 6.89% |
| Y 传播与文化产业 | 70,465,028.04 | 0.34% |
| M 综合类 | - | - |

合计 15,267,761.1746 74.40%

(三)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比例 |
|----|--------|------|------------|------------------|---------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 41,908,870 | 1,348,208,347.90 | 6.57% |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 35,050,429 | 1,240,736,186.60 | 6.05% |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 6,540,600 | 1,227,736,029.00 | 5.98% |
| 4 | 600383 | 广州药业 | 23,419,107 | 635,017,327.23 | 3.07% |
| 5 | 000732 | 盐湖钾肥 | 6,902,446 | 590,849,377.60 | 2.88% |
| 6 | 601390 | 中国中铁 | 82,933,585 | 587,169,781.80 | 2.86% |
| 7 | 000912 | 泸天化 | 23,187,462 | 548,151,601.68 | 2.67% |
| 8 | 600060 | 中国联通 | 57,770,918 | 511,890,316.76 | 2.49% |
| 9 | 000688 | 神州国旅 | 7,932,361 | 489,327,893.86 | 2.38% |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 10,820,754 | 432,830,160.00 | 2.11% |

(四)期末按券种分类的债券投资组合

| 债券类别 | 市值 | 市值占净值比例 |
|----------|----------------|---------|
| 国家债券投资 | - | - |
| 央行票据投资 | 100,010,000.00 | 0.49% |
| 企业债券投资 | 13,862,336.60 | 0.04% |
| 金融债券投资 | 99,800,000.00 | 0.49% |
| 可转换债券投资 | - | - |
| 国家政策性金融债 | - | - |
| 债券投资组合合计 | 332,892,336.60 | 1.62% |

(五)期末按市值占基金总资产比例大小排序的前五名债券明细

| 序号 | 债券名称 | 市值 | 市值占净值比例 |
|----|----------|----------------|---------|
| 1 | 08石化债 | 104,741,212.80 | 0.51% |
| 2 | 06央行票据40 | 100,010,000.00 | 0.49% |
| 3 | 04建行03债 | 99,800,000.00 | 0.49% |
| 4 | 08上广债 | 28,341,123.70 | 0.14% |

(六)投资组合报告附注

1.本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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备选股票库之外的股票。

3.期末其他资产情况

| 项目 | 金额 |
|---------|---------------|
| 交易保证金 | 12,263,047.27 |
| 应收证券清算款 | 26,395,232.33 |
| 应收利息 | 5,638,647.24 |
| 应收申购款 | 5,130,417.47 |
| 其他应收款 | 150,000.00 |
| 合计: | 49,575,374.41 |

4.期末未持有处于转股期的可转换债券

5.股指期货持仓及损益情况说明
本基金本报告投资期间内没有进行股指期货交易,因此未获得或发生的股指期货损益情况如下:

(1)本基金本报告投资期间内没有发生发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的证券。