

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

【重要提示】
本基金于2016年10月28日经中国证监会证监许可[2016]2455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备案,但不表明中国证监会对本基金募集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,投资者认购(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,投资者在投资本基金前,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,基金管理人运用基金资产过程中的基金管理人风险,同时由于本基金是交易型开放式基金,特定风险还包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险,标的指数波动的风险,基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险,标的指数变更的风险,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,退市风险,投资人申购失败的风险,投资人赎回失败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,主要采用完全复制跟踪标的指数创业板指数的表现,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。

场外申购赎回投资者的申购费率,赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变化而调整,投资人在办理场外申购、赎回业务时应仔细阅读本基金的招募说明书及基金管理人的相关公告。

投资者投资本基金时需具有深圳证券账户,但需注意,使用深圳证券交易所基金账户只能进行基金的资金确认和二级市场交易,如投资者需要使用创业板指数成份股中参与网上股票认购或资金的申购、赎回,则应开立深圳证券交易所 A 股账户。

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

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》。

本招募说明书内所载内容截止日为2017年10月25日,有关财务数据截止日为2017年9月30日,净值表现截止日为2017年6月30日(财务数据未经审计)。

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:孙树明
- 5、成立时间:2003年9月8日
- 6、电话:020-83969666
- 全国统一客服热线:05106828
- 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有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司,分别持有本基金管理人 51.13%、15.76%、15.76%、9.46%和 9.78%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员
孙树明先生:董事长,博士,高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事,党委书记,中国证券业协会第六届理事会兼职副会长,中国注册会计师协会道德准则委员会委员,中国资产评估协会常务理事,上海证券交易所第三理事会理事,上海证券交易所第一届上市公司咨询委员会委员,广东金融学会副会长,广东省互联网金融专家咨询委员会互联网金融规范组副组长,中证机构间报价系统股份有限公司副董事长,中国证券业协会法制处处长、处长,中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理,中共中央金融工作委员会监事会工作部部长,中国银河证券有限公司监事会监事,中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传贤先生:副董事长,学士,现任广发基金管理有限公司副总经理,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,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,深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理,瑞元资本管理有限公司总经理。

孙晓娟女士:董事,硕士,现任广发证券广东分公司副总经理、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长。曾任广东广发证券公司投资银行部经理,广发证券有限责任公司财务部董事,财务部副经理,广发证券股份有限公司投资银行部副总经理,广发基金管理有限公司财务总监、副总经理,广发证券期货有限公司财务总监。

段西军先生:董事,硕士,高级会计师,现任烽火通信科技股份有限公司总裁,兼任南京烽火星空通信发展有限公司董事。曾任烽火通信科技股份有限公司财务部总经理助理、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

崔丽卿女士:董事,硕士,现任深圳香江控股股份有限公司董事长、南方香江集团董事长、总经理,香江集团有限公司总裁,深圳市南海实业股份有限公司董事长。兼任全国政协常委,全国工商联常委,中国女企业家协会副会长,广东省妇联副主席,广东省女企业家协会会长,香港社会救助基金会会长,深圳香江控股集团股份有限公司董事,广东粤海银行董事,深圳龙岗国农银行董事。曾任深圳市前海香江金融控股集团有限责任公司法定代表人、董事长。

许冬雄女士:董事,硕士,副主任医师,现任康美药业股份有限公司副董事长、常务副总经理,兼任世界中医药学会联合会质量专业委员会副会长、国家中医药管理局对外交流合作专家咨询委员会委员、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,全国药典委员会标准化技术委员会中药制剂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药制剂与配置工程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。

罗晖先生:独立董事,博士,现任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理、集团机关党委书记,兼任保监会行业风险评估专家。曾任中国人民保险公司理赔办公室主任,湖北省分公司国际保险部党组书记、总经理、汉口分公司党委书记、总经理,太平保险有限公司市场部总经理、湖北分公司党委书记、总经理,助理总经理、副总经理兼董事会秘书,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,中华联合财产保险股份有限公司总经理、董事长、党委书记。

董克庆先生:独立董事,博士,现任宁波大学法学院教授、学术委员会主任,兼任海尔生物医药股份有限公司独立董事,复旦大学兼职教授。曾任复旦大学教授、法律系主任、法学院副院长。

姚海鑫先生:独立董事,博士、教授、博士生导师,现任辽宁大学新华国际学院教授、辽宁大学商学院博士生导师,兼任中国会计学会理事、东北区高校财务与会计教育联合会常务理事、辽宁省生产力学会副理事长、东北制药(集团)股份有限公司独立董事,沈阳红工股份有限公司独立董事和中兴-沈阳商业大厦(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、计划处处长、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、新华国际商学院副院长。

2、监事会成员

符兵先生:监事会主席,硕士,经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长,广东发展银行广州分行世联支行行长、总行资金部处长,广发基金管理有限公司广州分公司总经理、市场拓展部总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡亚娟女士:监事,硕士,高级涉外秘书,现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任,广州屈臣氏行政主管,广州市科达实业发展有限公司办公室主任,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。

吴晓晖先生:监事,硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分工工会主席,曾任广发证券电脑中心副经理、经理。

张成壮先生:监事,学士,现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师,广发证券股份有限公司工程师,广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘淑女女士:监事,硕士,现任广发基金管理有限公司产品营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场部拓展部经理助理,营销服务部总经理助理,产品营销管理部总经理助理。

3、总经理及其他高级管理人员
林传贤先生:总经理,学士,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,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,深圳证券交易所第四届上市复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理,瑞元资本管理有限公司总经理。

宋平先生:副总经理,硕士,经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理,广发证券投资银行华南业务部副经理,中国证券投资基金业协会第六届创业板发行审核委员会委员兼联席委员。

易阳方先生:副总经理,硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发发展混合型证券投资基金基金经理,广发聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发聚源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发创毅驱动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资产管理部总经理,总经理助理,广发发展开放式证券投资基金基金经理,广发制造精选灵活配置证券投资基金基金经理。

段西军先生:督察长,博士。曾在广东省佛山财贸学校,广发证券股份有限公司、中国证监会广东监管局工作。

邱春杨先生:副总经理,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总经理,金融工程部总经理、产品总监、金融工程部总经理。

魏恒川先生:副总经理,硕士,高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员,曾在水利部,广发证券股份有限公司工作,历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理,综合管理部总经理、总经理助理。

张敬蕊女士:副总经理,硕士,兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国科学院助理

研究员,中国证监会培训中心、监察科科员,基金监管部副处处长及处长,私募基金监管部处长。

4、基金经理
刘先生:工学学士,持有中国证券投资基金业协会从业证书,曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)。现任广发基金管理有限公司数量投资部总经理助理,广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日起任职),广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理(自2014年4月1日起任职),广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年8月20日起任职),广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2016年1月18日起任职),广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2016年1月25日起任职)、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2016年1月25日起任职),广发中证券商产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日起任职),广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日起任职),广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年9月26日起任职),广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年1月25日起任职),广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年5月25日起任职),广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自2017年6月4日起任职)。

5、基金投资决策采取集体决策机制。基金管理人权益公募投委会由副总经理宋平先生、权益投资一部总经理李熹先生和开发策略部总经理孙迪先生等成员组成,宋平先生担任投委会主席。基金管理人固定收益投委会由固定收益投资总监张平女士、债券投资部总经理胡星先生、现金投资部总经理蒋秀娟女士、债券投资部副经理代宇女士和固定收益研究部副经理韩晓生等成员组成,张平女士担任投委会主席。

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58号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币36,640,625.71万元
联系电话:010-61601099
联系人:郭明

二、基金托管部门及主要人员情况
截至2017年6月30日,中国工商银行资产托管部共有员工218人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、证券投资基金托管情况
作为中国大陆托管服务的先行者,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,依靠雄厚的风险管理和内部控制体系,规范的管理模式,先进的运营系统和专业的服务团队,为合格资产托管人负责,为海内外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供安全、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最高、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、各类养老金、FOF产品、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、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、QDII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跨境托管服务,可为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年6月,中国工商银行共托管证券投资基金745只。自2003年以来,本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、《英国全球财讯》、《香港《财资》》、《美国《环球金融》》、内地《证券时报》、《上海证券报》等海内外权威媒体组织的14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广泛好评。

第三部分相关服务机构

一、基金份额发售机构
1、发售机构名称
名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区河北路183-187号大都会广场4楼(4301-4316房)
办公地址:广州市天河区珠江新城华夏路18号
法定代表人:孙树明
联系人:黄枫
客服电话:95575
开放式基金业务传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn
2、网上基金发售代理机构和网下股票发售直销机构
本公司通过在上海、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。

(1)广州分公司
地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔17楼
直销中心电话:020-89809073
传真:020-89890699 020-89890070

(2)北京分公司
地址:北京市西城区德胜门大街6号院1号环球财讯中心D座11层
电话:010-68003388
传真:010-68003078

(3)上海分公司
地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴东路166号906-10室
电话:021-68885310
传真:021-68885200

(4)网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。
本公司网上交易系统网址:www.gfund.com.cn
本公司网址:www.gfund.com.cn
客服电话:95105828(华北地区)
客服热线:020-34281105
(5)投资人也可通过本公司客户服务热线电话进入本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

6、网上基金和网下股票发售代理机构
详见本基金发售公告。
7、网上基金发售代理机构
详见本基金发售公告。
8、本基金申购赎回获得基金份额认购资格的上交所会员单位可通过上交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。
基金管理人可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或变更上述发售代理机构,并及时公告。

二、注册登记人
1、场内份额
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:金磊
联系人:崔巍
电话:010-50938866
传真:010-50938757

2、场外份额
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
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
电话:020-89188970
传真:020-89899175

3、出让人:李尔华
三、律师事务所和会计师事务所
名称:北京中盈(广州)律师事务所
住所:广州市广州大道中289号万博大厦B座15-18层
负责人:牟晋军
电话:020-66857288

传真:020-66857289
经办律师:刘智、陈琛
联系人:牟晋军
四、审计会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯坤
联系人:洪根明
电话:021-61418888
传真:021-63250003
经办注册会计师:洪根明、江丽雁

第四部分基金的名称

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金

第五部分基金的投资

股票型、指数型证券投资基金

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、部分基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数(即创业板指)的成份股、备选成份股,为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的其他股票)、债券、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规和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,将其纳入基金投资范围。

在完成建仓后,本基金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%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股构成及其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动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%且不低于非现金基金资产的80%。

一般情况下,本基金将跟踪标的指数的成份股构成及其权重构建股票资产投资组合,但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等行为导致成份股的构成及其权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或流动性不足等原因导致投资无法及时完成投资组合的同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素选择跟踪的指数中其他成份股或备选成份股进行替代,以期在规定的风险承受范围之内,力争提高跟踪精度,降低跟踪误差,而非由于投机或利用杠杆扩大基金的投资。

在正常情况,本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于0.2%,年度跟踪误差不超过2%。

本基金除跟踪标的指数和其他中国证监会允许的衍生品金融产品,如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具外,本基金投资跟踪标的指数的其他金融工具,以期在规定的风险承受范围之内,力争提高跟踪精度,降低跟踪误差,而非由于投机或利用杠杆扩大基金的投资。

九、部分业绩比较基准
本基金标的指数为创业板指数,本基金的业绩比较基准为标的指数的收益率。

创业板指数是深圳证券交易所编制,以2010年5月31日为基日,基点为1000点,旨在创业板市场运行的运行情况,为投资人提供创业板市场投资参考的指数。

如果指数编制方法变更或停止指数的编制,如发生更名、更名、或标的指数由其他指数替代,或由由指数编制方法变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合作为跟踪的指数时,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,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称,其中,若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),在不违反法律法规和《基金合同》约定,并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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后,报中国证监会备案并发布公告。

十、基金费用
本基金标的指数为创业板指数,本基金的业绩比较基准为标的指数的收益率。

创业板指数是深圳证券交易所编制,以2010年5月31日为基日,基点为1000点,旨在创业板市场运行的运行情况,为投资人提供创业板市场投资参考的指数。

如果指数编制方法变更或停止指数的编制,如发生更名、更名、或标的指数由其他指数替代,或由由指数编制方法变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合作为跟踪的指数时,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,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称,其中,若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),在不违反法律法规和《基金合同》约定,并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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后,报中国证监会备案并发布公告。

十一、基金费用
本基金管理人及基金托管人根据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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年11月21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,保证复核对内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本投资组合业绩数据截至2017年9月30日,本报告中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	236,384,00862	92.06
	其中:股票	236,384,00862	92.06
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	20,131,80008	7.87
7	其他资产	187,89410	0.07
8	合计	256,703,73237	100.00

注:上表中的股票投资项下含可替代估值增值,而表中的合计项不含可替代估值增值。

2、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	17,047,58930	6.90
B	采矿业	--	--
C	制造业	120,028,24844	48.67
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	31,03844	0.01
E	建筑业	4,496,42838	1.89
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	60,716,39880	24.57
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	2,262,96649	0.91
M	科学研究和技术服务业	1,376,74800	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	12,293,07603	4.87
O	住宿服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生健康工作	6,206,29978	2.59
R	文化、体育和娱乐业	10,546,13301	4.28
S	综合	--	--
	合计	236,384,00862	96.26

(1)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。
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	300888	嘉益股份	762,543	17,047,58930	6.90
2	300059	东方财富	624,022	8,642,80930	3.57
3	300136	欧菲光学	166,061	6,838,74200	2.70
4	200124	汇川技术	222,769	6,427,77816	2.61
5	300070	普瑞光电	323,983	5,833,82023	2.36
6	300072	三孚环保	187,939	5,724,41322	2.22
7	300048	三环集团	227,047	5,602,76723	2.27
8	300024	机器人	261,640	5,576,18000	2.26
9	300033	乐视网	139,267	4,156,24183	1.68
10	300017	中航科工	222,913	3,897,56939	1.58

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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、本基金持有的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

10、本基金持有的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权。

11、本基金持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有流通受限证券。

12、本基金持有的停牌股票
本基金本报告期末未持有停牌股票。

13、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

14、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

15、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

16、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

17、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

18、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

19、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

20、本基金持有的其他金融资产
本基金本报告期末未持有其他金融资产。

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)本基金本报告期内未有股指期货交易。

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)本基金本报告期内未有国债期货交易。

11、投资组合报告附注
(1)报告期内,无投资科创板股票。
(2)报告期内,无投资科创板股票。
(3)报告期内,无投资科创板股票。

(4)报告期内,无投资科创板股票。
(5)报告期内,无投资科创板股票。
(6)报告期内,无投资科创板股票。
(7)报告期内,无投资科创板股票。
(8)报告期内,无投资科创板股票。
(9)报告期内,无投资科创板股票。
(10)报告期内,无投资科创板股票。
(11)报告期内,无投资科创板股票。
(12)报告期内,无投资科创板股票。
(13)报告期内,无投资科创板股票。
(14)报告期内,无投资科创板股票。
(15)报告期内,无投资科创板股票。
(16)报告期内,无投资科创板股票。
(17)报告期内,无投资科创板股票。
(18)报告期内,无投资科创板股票。
(19)报告期内,无投资科创板股票。
(20)报告期内,无投资科创板股票。
(21)报告期内,无投资科创板股票。
(22)报告期内,无投资科创板股票。
(23)报告期内,无投资科创板股票。
(24)报告期内,无投资科创板股票。
(25)报告期内,无投资科创板股票。
(26)报告期内,无投资科创板股票。
(27)报告期内,无投资科创板股票。
(28)报告期内,无投资科创板股票。
(29)报告期内,无投资科创板股票。
(30)报告期内,无投资科创板股票。
(31)报告期内,无投资科创板股票。
(32)报告期内,无投资科创板股票。
(33)报告期内,无投资科创板股票。
(34)报告期内,无投资科创板股票。
(35)报告期内,无投资科创板股票。
(36)报告期内,无投资科创板股票。
(37)报告期内,无投资科创板股票。
(38)报告期内,无投资科创板股票。
(39)报告期内,无投资科创板股票。
(40)报告期内,无投资科创板股票。
(41)报告期内,无投资科创板股票。
(42)报告期内,无投资科创板股票。
(43)报告期内,无投资科创板股票。
(44)报告期内,无投资科创板股票。
(45)报告期内,无投资科创板股票。
(46)报告期内,无投资科创板股票。
(47)报告期内,无投资科创板股票。
(48)报告期内,无投资科创板股票。
(49)报告期内,无投资科创板股票。
(50)报告期内,无投资科创板股票。
(51)报告期内,无投资科创板股票。
(52)报告期内,无投资科创板股票。
(53)报告期内,无投资科创板股票。
(54)报告期内,无投资科创板股票。
(55)报告期内,无投资科创板股票。
(56)报告期内,无投资科创板股票。
(57)报告期内,无投资科创板股票。
(58)报告期内,无投资科创板股票。
(59)报告期内,无投资科创板股票。
(60)报告期内,无投资科创板股票。
(61)报告期内,无投资科创板股票。
(62)报告期内,无投资科创板股票。
(63)报告期内,无投资科创板股票。
(64)报告期内,无投资科创板股票。
(65)报告期内,无投资科创板股票。
(66)报告期内,无投资科创板股票。
(67)报告期内,无投资科创板股票。
(68)报告期内,无投资科创板股票。
(69)报告期内,无投资科创板股票。
(70)报告期内,无投资科创板股票。
(71)报告期内,无投资科创板股票。
(72)报告期内,无投资科创板股票。
(73)报告期内,无投资科创板股票。
(74)报告期内,无投资科创板股票。
(75)报告期内,无投资科创板股票。
(76)报告期内,无投资科创板股票。
(77)报告期内,无投资科创板股票。
(78)报告期内,无投资科创板股票。
(79)报告期内,无投资科创板股票。
(80)报告期内,无投资科创板股票。
(81)报告期内,无投资科创板股票。
(82)报告期内,无投资科创板股票。
(83)报告期内,无投资科创板股票。
(84)报告期内,无投资科创板股票。
(85)报告期内,无投资科创板股票。
(86)报告期内,无投资科创板股票。
(87)报告期内,无投资科创板股票。
(88)报告期内,无投资科创板股票。
(89)报告期内,无投资科创板股票。
(90)报告期内,无投资科创板股票。
(91)报告期内,无投资科创板股票。
(92)报告期内,无投资科创板股票。
(93)报告期内,无投资科创板股票。
(94)报告期内,无投资科创板股票。
(95)报告期内,无投资科创板股票。
(96)报告期内,无投资科创板股票。
(97)报告期内,无投资科创板股票。
(98)报告期内,无投资科创板股票。
(99)报告期内,无投资科创板股票。
(100)报告期内,无投资科创板股票。

(4)报告期内,无投资科创板股票。
(5)报告期内,无投资科创板股票。
(6)报告期内,无投资科创板股票。
(7)报告期内,无投资科创板股票。
(8)报告期内,无投资科创板股票。
(9)报告期内,无投资科创板股票。
(10)报告期内,无投资科创板股票。
(11)报告期内,无投资科创板股票。
(12)报告期内,无投资科创板股票。
(13)报告期内,无投资科创板股票。
(14)报告期内,无投资科创板股票。
(15)报告期内,无投资科创板股票。
(16)报告期内,无投资科创板股票。
(17)报告期内,无投资科创板股票。
(18)报告期内,无投资科创板股票。<