

广发沪深300指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及董事等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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的投资业绩并不表示其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

投资目标
通过严谨的投资程序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,力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过±0.35%。

投资策略
本基金为指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重和流动性状况进行投资。当期成份股调整或发生分红、增发、分红再行投资,以及因基金的申购和赎回等导致基金跟踪误差扩大时,基金管理人有权对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

业绩比较基准
95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款收益率

风险收益特征
本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金。

基金管理人
广发基金管理有限公司

基金托管人
中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)

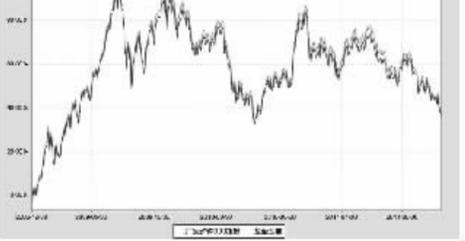
注:1.上述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益减去本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
009年11月26日至2011年9月30日



注:本基金建仓期为基金合同生效后3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理小组 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期和 离任日期指公司公告聘任或解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发沪深300指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律、法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法律法规的规定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金管理人未管理有与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
8 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内,本基金日均跟踪误差为0.06%,符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过±0.35%的限制。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金净值为0.865元,本报告期基金份额净值增长率为-14.98%,业绩比较基准收益率为-14.98%。

4.4.3 报告期内基金的投资组合报告
截至本报告期末,本基金资产配置如下:1.股票:63.57%,2.债券:38.34%,3.货币:0.09%,4.权证:0.00%,5.其他:0.00%。

4.4.4 报告期内基金投资组合的行业分布
截至本报告期末,本基金行业配置如下:1.农林牧渔:1.99%,2.采掘业:1.20%,3.制造业:1.66%,4.食品饮料:4.28%,5.医药、生物制品:5.73%,6.其他制造业:1.25%,7.其他:0.00%。

4.4.5 报告期内基金投资组合的流动性分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在流通受限的情况。

4.4.6 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.7 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.8 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.9 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.10 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.11 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.12 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.13 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.14 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.15 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.16 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.17 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.18 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.19 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.20 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.21 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.22 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.23 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.24 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.25 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.26 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.27 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.28 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.29 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.30 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.31 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.32 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.33 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.34 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.35 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.36 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.37 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.38 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.39 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.40 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.41 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.42 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.43 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.44 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.45 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.46 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.47 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.48 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.49 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.50 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.51 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.52 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.53 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.54 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.55 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.56 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.57 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.58 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.59 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.60 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.61 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.62 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.63 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.64 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.65 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.66 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.67 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.68 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.69 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.70 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.71 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.72 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.73 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.74 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.75 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.76 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.77 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.78 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.79 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.80 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.81 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.82 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.83 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.84 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.85 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.86 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.87 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.88 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.89 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.90 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.91 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.92 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.93 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.94 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.95 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.96 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.97 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.98 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.99 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.100 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.101 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.102 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.103 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.104 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.105 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.106 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.107 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.108 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.109 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.110 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.111 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.112 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.113 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.114 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.115 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.116 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.117 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.118 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.119 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.120 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.121 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.122 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.123 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.124 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.125 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.126 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.127 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.128 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.129 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.130 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.131 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.132 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.133 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.134 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.135 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.136 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.137 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.138 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.139 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.140 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.141 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.142 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.143 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.144 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.145 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.146 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.147 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.148 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.149 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.150 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.151 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.152 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.153 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.154 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.155 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.156 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.157 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.158 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.159 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.160 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.161 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.162 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.163 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。

4.4.164 报告期内基金投资组合的公允价值分析
截至本报告期末,本基金投资组合中不存在公允价值变动的情况。