

深证成份交易型开放式指数证券投资基金

上证380交易型开放式指数证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年 3月 31日

2012 第一季度 报告

2012年 3月 31日

<b>基金管理人:南方基金管理有限公司</b> <b>基金托管人:中国工商银行股份有限公司</b> <b>报告送出日期:2012年4月23日</b>	
<b>§1 重要提示</b> 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2012年04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。 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。 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。 本报告期自2012年01月01日起至2012年03月31日止。	
<b>§2 基金产品概况</b>	
基金简称	南方上证380ETF
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年12月4日
报告期末基金份额总额	2,904,254,507.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的权重进行配置,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和成份股发生增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等导致本基金跟踪标的指数的投资比例需要调整时,或因某些成份股流动性不足时,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调整和跟踪,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金的指数为上证380指数。 如果指数编制单位变更或停止上证380指数的编制及发布,或上证380指数由其他机构替代,或由指数编制单位变更和调整,基金管理人有权变更业绩比较基准为标的指数,或证券市场有其他代表性强、更合适投资的指数出现时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金股票型基金,跟踪沪深两市综合基金、债券基金和货币市场基金。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。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

### 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比较

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
过去三个月	5.34%	1.66%	5.51%	1.66%	-0.17%	0.00%

#### 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比较

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比较

### 5.2 报告期末按股票投资资产分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.3 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	000002	万科A	29,711,950	246,014,946.00	8.87
2	200058	五粮液	6,161,061	202,329,243.24	7.30
3	000051	格力电器	7,425,728	159,965,050.24	5.44
4	000264	苏宁电器	14,827,147	144,564,683.25	4.17
5	000001	深发展A	9,028,205	141,833,100.55	5.12
6	000157	中联重科	11,415,931	122,243,962.46	4.41
7	000063	中兴通讯	6,421,769	105,509,664.67	3.81
8	002304	洋河股份	666,611	98,091,808.65	3.54
9	000568	泸州老窖	2,387,297	93,319,439.73	3.37
10	000527	美的电器	6,174,396	81,008,075.52	2.92

### 5.3.2 报告期末按股票投资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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.4 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。

### 5.5 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。

### 5.6 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。

### 5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.8 投资组合报告附注

注:本基金建仓期为三个月,建仓结束后各项资产配置比例符合合同约定。基金合同中关于本基金的投资范围、投资策略、投资组合比例限制等的条款与上述跟踪标的指数的表现,正常情况下,本基金的投资比例符合约定。

§4 管理人报告				
4.1 基金管理人 统基金经营小组 简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
潘涌宁	本基金基金经理	2009年12月4日	11	曾任汇添富,具有基金从业资格,曾任任职于南方证券股份有限公司,加入南方基金,历任行业研究员、基金基金经理助理、投资部总监助理、数量投资部基金经理等职务,2009年3月1日至,任南方380指数证券投资基金,2009年12月4日至今,任南方上证380ETF及联接基金基金经理,2011年2月5日至今,任南方500指数基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求长期利益。报告期内,本基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为13次,其中12次是由于报告期内跟踪标的指数成分股停牌,1次是由于接受大额申购使得基金规模增大,配置比例所需。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
2012年1季度,市场整体呈现探底回升格局,报告期内,深证成指涨幅为+5.51%。  
我们通过对自建“指数化交易系统”、“日内择时交易系统”、跟踪误差归因分析系统”、ETF基金流程管理系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:  
①由于跟踪标的指数的成份股权重变化,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;  
②对于现金偏差,我们通过ETF基金流程管理系统,在确保安全的前提下将现金比例降至较低水平,极大的减少了持有现金对本基金跟踪标的指数的负面影响;  
③在跟踪过程中,我们根据指数的年度成份股调整进行了基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,从实施结果来看,效果非常好,跟踪误差控制在极小范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
自本基金建仓以来,基金跟踪标的指数年化跟踪误差为70.444%,年初至本报告期末年化跟踪误差为0.069%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差率不超过2%的投资目标,并保持与净值同步增长。  
截至报告期末,本基金份额净值为0.9547,报告期内,份额净值增长率为5.34%,同期业绩基准增长率为5.51%。

5.8.1 基金管理人:本基金投资的前十名证券发行主体未被监管部门立案调查,本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰联合(000538),没有存在报告期内前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

根据2011年5月27日宜宾五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000858)《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》的公告,中国证监会证券监督管理委员会决定:“中华人民共和国证券监督管理委员会:宜宾五粮液(0)于2011年4月,宜宾五粮液股份有限公司(下称:五粮液)在证券市场中存在违法违规行为,中国证监会决定:“中国证监会决定

<b>基金管理人:南方基金管理有限公司</b> <b>基金托管人:中国工商银行股份有限公司</b> <b>报告送出日期:2012年4月23日</b>	
<b>§1 重要提示</b> 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2012年4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。 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。 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。 本报告期自2012年01月01日起至03月31日止。	
<b>§2 基金产品概况</b>	
基金名称	南方上证380ETF联接
基金代码	202025
交易代码	202025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	171,417,983.32份
投资目标	投资于上证380交易型开放式指数证券投资基金(以下简称380ETF),紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,以380ETF为主要投资标的,方便特定的客户通过投资380ETF,本基金并不直接参与380ETF的管理。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证380指数收益率*95%+银行活期存款利率*后5%。
风险收益特征	本基金属股票基金,跟踪沪深两市综合基金、债券基金和货币市场基金。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。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	
单位:人民币元	
报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)	
1.本期已实现收益	-3,220,469.47
2.本期利润	1,781,696.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111
4.期末基金资产净值	145,054,214.13
5.期末基金份额净值	0.8462
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。	
<b>3.2 基金净值表现</b>	
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比较	

§5 投资组合报告			
5.1 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	2,771,809,687.73	99.86
	其中:股票	2,771,809,687.73	99.86
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	3,392,908.97	0.12
6	其他资产	435,819.57	0.02
7	合计	2,775,638,416.27	100.00
注:上表中的股票投资项下可进一步细分为公允价值,而5.2的合计项中不可进一步细分为公允价值。			
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
5.2.1 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	-	-
B	采掘业	172,745,765.57	6.23
C	制造业	1,662,034,876.17	59.95
D	食品、饮料	497,190,158.68	17.93
E	纺织、服装、皮毛	-	-
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	-	-
H	石油、化学、塑胶、塑料	68,025,601.60	2.45
I	电子	-	-
J	金属、非金属	383,166,214.89	13.82
K	机械、设备、仪表	548,076,338.32	19.77
L	医药、生物制品	165,576,564.68	5.97
M	其他制造业	-	-
N	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
O	建筑业	-	-
P	交通运输、仓储业	-	-
Q	信息技术业	105,509,664.67	3.81
R	批发和零售业	144,564,683.25	5.21
S	金融、保险业	327,685,154.81	11.82
T	房地产业	297,767,266.20	10.74
U	社会服务业	61,502,277.06	2.22
V	传播与文化产业	-	-
W	综合类	-	-
	合计	2,771,809,687.73	99.97
5.2.2 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			
本基金本报告期末未持有股票投资。			
5.3 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			
本基金本报告期末未持有债券。			
5.4 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			
本基金本报告期末未持有资产支持证券。			
5.5 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权证投资明细			
本基金本报告期末未持有权证。			
5.6 投资组合报告附注			
5.6.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.2 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.3 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.4 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.5 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.6 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.7 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.8 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.9 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.10 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.11 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.12 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.13 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.14 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.15 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.16 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.17 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.18 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.19 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.20 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.21 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.22 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.23 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.24 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.25 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.26 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.27 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.28 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.29 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.30 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.31 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.32 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.33 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.34 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.35 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.36 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.37 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.38 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.39 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.40 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.41 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.42 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.43 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.44 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.45 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.46 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.47 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.48 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.49 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.50 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.51 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.52 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.53 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.54 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.55 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.56 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.57 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.58 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.59 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.60 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.61 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.62 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.63 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.64 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.65 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.66 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.67 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.68 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.69 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.70 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.71 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.72 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.73 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.74 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.75 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.76 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.77 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.78 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.79 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.80 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.81 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.82 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.83 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.84 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.85 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.86 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.87 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.88 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.89 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.90 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.91 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.92 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.93 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.94 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.95 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.96 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.97 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.98 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.6.99 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			
5.7 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。			