

(上接B30期)

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%—95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%—10%，其中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%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规及监管机构的相关规定。

第八部分 基金的投资策略及投资组合管理

本基金采用指数复制策略相结合增强投资策略，即通过指数复制的方法跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强组合管理。指数复制策略，即按照标的指数的成份构成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份及其权重的变动进行相应调整。如因特殊情况导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能接近标的指数的表现。在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，本基金还将采取相对增强的投资策略，追求通过基本面分析对指数成份股进行优化调整，并辅以其他增强策略，以求提高本基金的投资收益率。

1. 资产配置策略
本基金为增强型股票基金，股票投资比例为基金资产的90%—95%，其中沪深300指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%。除因分红或基金持有人赎回申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过结合公司投研团队的基本面研究及量化投资技术，控制标的指数的跟踪误差和下方跟踪误差，追求接近或超越标的指数的表现。

2. 股票投资策略
本基金股票资产投资采用指数增强复制策略，即根据沪深300指数成份股的基础权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动进行相应调整；同时，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，本基金将剔除或低配部分明显高估的标的指数成份股，并辅以量化增强及其他辅助增强策略，以期达到增强投资的目的。

(1) 指数复制策略 (Index Replication Strategy)
本基金采用指数复制策略进行资产配置。通常情况下，指数复制策略是指跟踪标的指数成份股在指数中的权重来构成定购的买卖数量。在买卖成份股的过程中，尤其在基金建仓期间，本基金可采取适当方法，以降低建仓成本。

在特殊情况下，本基金可以选择其他股票或股票组合用来替换标的指数中的股票，这些情况包括但不限于以下三种：①因法律法规的限制或股票停牌等原因，导致本基金不能投资相关股票；②因本基金资产规模过大，导致本基金持有股票比例过高；③标的指数成份股流动性不足等。

进行替换的股票应符合如下条件：①以标的指数成份股及其备选成份股中选择用以替换的股票；②用以替换的股票与标的指数股票属于同一行业；③用以替换的股票具有较好的流动性；④替换后，该成份股所在行业在本基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重基本一致；⑤用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考察期内收益与风险指标相关性高且相关，能较好地代表被替换股票的风险收益状况；⑥在同一行业中，如无法找到用以替换的股票者买入不能用以替换的股票。本基金将综合考虑跟踪误差和投资收益率因素，从标的指数成份股及其备选成份股中，选择用以替换的股票或股票组合。

根据现有法律法规，本基金不能投资于基金管理人发行的股票，本基金将遵循以下原则对基金托管人发行的股票进行替换：①其他行业个股选择用以替换的股票或股票组合；②用以替换的股票或股票组合与标的指数中其他股票的风险权重基本一致；③用以替换的股票或股票组合与被替换股票的风险收益特征与个股高度相关，能较好地代表基金管理人发行股票的收益率波动情况。若未来法律法规取消上述限制，本基金可将基金管理人发行的股票纳入投资范围。

(2) 股票增强策略 (Equity-based Enhancement Strategy)
本基金在控制跟踪误差和下方跟踪误差，加强风险管理的基础上，进行适度的增强性投资。本基金采取基于基金资产的个股相对增强投资策略，即剔除或低配部分标的指数成份股，用其他股票或股票组合进行替换，同时辅以其他增强策略，以求提高跟踪误差收益。增强性投资会加大投资仓位相对于基准的偏离度，因此本基金采用“跟踪误差”和“下方跟踪误差”这两类指标对投资组合进行监控与评估，进而对增强性投资策略达成协议，不超过日跟踪误差率不超过0.5%，年跟踪误差率不超过7.5%，日均下方跟踪误差率不超过0.3%，年下方跟踪误差率不超过4.75%。

A. 基于基金面的增强 (Fundamental-based Enhancement)
鉴于中国资本市场的低效性，存在部分股票估值不合理现象，本基金将通过对标的指数成份股及其备选成份股的基本面分析，剔除或低配部分标的指数成份股，以达到增强组合收益的效果。具体而言，本基金将剔除或低配具备以下一项或多项特征的股票：
①基本面较差，缺乏核心竞争力、经营业绩下滑；
②当前股价水平明显高于中长期估值水平，在可比公司中，股票相对估值偏高；
③股价涨幅严重透支其现有业绩支持的股票；
④其他特殊个股，例如短期涨幅从指数中脱离的个股，面临重大的不利行政处罚或司法诉讼的个股，有充分合理的理由认为其市场价格被高估的股票。

B. 基于Alpha因子的增强
① 基本面因子：包括市值、盈利、市场相对四大类因子，建立Alpha多因子模型。大类因子由一系列单因子组成，其中的值因子主要指股票的绝对和相对估值水平，包括市盈率、市净率、EV/EBITDA等指标；成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的历史增长和预期增长；盈利因子主要包括上市公司毛利率、净利润率、净资产收益率等指标的绝对和相对水平；市场相对因子主要包括股票价格的波动率/换手率、股票的价格/市值以及其他风格因子。
② Alpha因子模型：将上述Alpha因子按权重进行综合评分，并根据评分结果，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，对沪深300指数成份股进行权重优化，作为指数增强投资中的参考。

C. 其他增强策略 (Other Enhancement)
本基金还可采取以下增强投资策略，以期在控制风险的前提下，获取超额收益。本基金可投资预期将纳入指数的个股，以及新股发行，增发或配股在内的具有重大投资价值的股票，以增强基金的投资收益。

3. 权证投资策略
本基金将综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资，以提高投资效率，增强基金的投资收益。

4. 债券投资策略
本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券、金融债等。

在法律法规允许时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具，对基金投资组合进行管理。

5. 股票指数化投资日常投资管理
(1) 定期调整
根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，尽量减少标的指数成份股变动带来的跟踪误差和下方跟踪误差。

(2) 不定期调整
A. 若出现标的指数成份股临时调整的情况，本基金管理人将密切关注标的指数的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

B. 跟踪标的指数成份股及其备选成份股公司信息，包括股本变化、分红、派股、增发、停牌、复牌，以及其他重大信息，分析上述信息对指数的影响，并据此及时确定基金投资组合中的每日交易策略。

C. 根据本基金申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

D. 本基金将参与一级市场股份认购和上市公司增发或配股，由此得到的股票将在其规定持有期后的10个工作日内全部上市，其中标的指数成份股及其备选成份股或即将成为成份股或备选股的除外。

E. 因本基金基金合同约定的基金管理人以外的原因导致投资组合超出基金合同约定的时，基金管理人将在法律法规允许的范围内及时予以合同限制调整。

(3) 跟踪误差的监控与管理
本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金净值增长率与业绩比较基准收益之间的日均跟踪误差率不超过0.5%，年跟踪误差率不超过7.5%，日均下方跟踪误差率不超过0.3%，年下方跟踪误差率不超过4.75%，每日对基金组合与业绩比较基准的收益偏离度进行跟踪，每月、每季度末度评析基金跟踪误差变化情

况及其原因，并给出优化跟踪误差的基金管理方案。日均跟踪误差和日均下方跟踪误差的计算公式如下：

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

况及其原因，并给出优化跟踪误差的基金管理方案。日均跟踪误差和日均下方跟踪误差的计算公式如下：

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

其中， R_{it} 为基金组合在t日的收益率， R_{bt} 为业绩比较基准在t日的收益率， $R_{d,t}$ 为基金组合在t日的下方跟踪误差率。

代码	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	600016	民生银行	6,700,000	64,588,000.00	5.04
2	601318	中国平安	1,227,000	51,251,790.00	4.00
3	600036	招商银行	3,900,000	49,257,000.00	3.84
4	601166	兴业银行	2,562,412	44,329,722.00	3.46
5	000005	深发展A	515,000	44,193,000.00	3.35
6	600000	浦发银行	4,105,200	41,599,740.00	3.24
7	601328	交通银行	7,690,000	33,393,000.00	2.60
8	601088	中国神华	1,270,000	27,660,000.00	2.16
9	000033	神州高铁	4,084,417	26,766,646.37	2.07
10	000002	万科A	2,287,711	24,645,776.36	1.92
合计				66,762,794.70	5.21

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
(1) 期末积极投资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	000016				