

(上接 C87 版)

办公地址:山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:韩爽
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619

(40)平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
办公地址:深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
法定代表人:曹实凡
联系人:石静武
电话:021-38631117
传真:021-58991896

(41)中泰证券股份有限公司
住所:济南市市中区经七路 86 号
办公地址:济南市中区经七路 86 号
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
电话:021-20315290
传真:0531-68889095

(42)上海联合泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层
法定代表人:燕斌
联系人:兰蔚
电话:021-52822063
传真:021-52975270

(43)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元
办公地址:北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层
法定代表人:赵学军
联系人:李雯
电话:010-60842306
传真:010-85712195
传真:021-52975270

(44)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海
浦东经济开发区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人:王翔
联系人:屈晓菲
电话:021-6537-0077*249
传真:021-5508-5991

(45)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 3 A 座 19 层
法定代表人:钟斐斐
联系人:袁永姣
电话:15011386983

(46)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
法定代表人:陈灿辉
电话:021-38784818
传真:021-68774818
联系人:陈媛
网址:www.shhxzq.com

(47)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02
单元
办公地址:深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层
法定代表人:王连志
电话:0755-82558323
传真:0755-82558166
联系人:刘志斌
网址:www.essence.com

(48)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01-02、03 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01-02、03 室
法定代表人:冷飞
联系人:冷飞
电话:021-50810687
传真:021-58300279
网址:www.wacai.com

(49)上海攀赢基金销售有限公司
注册地址:上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室
法定代表人:田为奇
联系人:吴卫东
电话:021-68889082
传真:021-68889283
网址:www.pytz.cn

(50)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:刘汗青
联系电话:025-66996699-887226
联系人:王锋
网址:jinnong.suning.com

(二)登记机构
机构名称:新疆前海联合基金管理有限公司
住所:新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室
法定代表人:王晓辉
办公地址:深圳市福田区华富路 1018 号中航中心 26 楼
电话:0755-25129526
传真:0755-82789277
客服电话:400-640-0099
联系人:陈艳

(三)律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华
电话:021-31358666
传真:021-31358600

(四)会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室
办公地址:上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:李煜煜
经办注册会计师:薛竞、李煜煜

四、基金的名称
新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金
五、基金的类型
股票型证券投资基金
六、基金的运作方式
契约型开放式
七、基金的投资
(一)基金的投资目标
本基金采用被动式投资策略,通过紧密跟踪标的指数,力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

(二)投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成分股及其备选成分股,包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、权证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具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)。

基金的投资组合比例为:本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%,本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算准备金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

(三)投资策略
本基金采用完全复制标的指数的方法,进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟

踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数的编制方法调整、成份股及其权重发生变化(包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等)的原因,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,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变通和调整,力求降低跟踪误差。

1. 资产配置策略
本基金管理人主要按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2. 股票投资策略
(1)股票投资组合构建
本基金采用完全复制标的指数的方法,按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异,若出现较为特殊的情况(例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素),本基金将采用替代性的方法构建组合,使得跟踪组合尽可能接近于全复制组合,以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%的投资比例限制。

(2)股票投资组合的调整
本基金所构建的股票投资组合将根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

1. 定期调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。
2. 不定期调整
①当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;
②根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

③根据法律、法规和基金合同的规定,成份股在标的指数中的权重因其其他特殊原因发生相应变化的,本基金可对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
在正常市场情况下,力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

3. 债券投资策略
本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资,通过主要采取组合久期配置策略,同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4. 股指期货投资策略
本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险敞口分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和市场因素等,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股指期货的总体规模,以及中国证监会的相关规定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。
若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

5. 资产支持证券投资策略
本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响,同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

(四)投资管理
1. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%;
(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算准备金、存出保证金及应收申购款等;
(3)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
(4)本基金持有一家公司的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;
(5)本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券,不超过该证券的 10%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的 10%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
(12)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
(15)本基金仅在投资股指期货时,遵循以下限制:在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;在任何交易日日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
(16)本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;
(17)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(18)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(19)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第(2)、(12)、(17)、(18)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资组合比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准,但须与基金托管人协商一致后方可纳入基金托管人投资监督范围。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
如法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

3. 关联交易原则
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事同

意。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

(五)业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

2、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制,上海证券交易所和深圳证券交易所于 2005 年 4 月 8 日联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。沪深 300 指数编制的目标是反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况,并能够作为投资业绩的评价标准,为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。

如果指数编制单位变更或停止沪深 300 指数的编制、发布或授权,或沪深 300 指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为沪深 300 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、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,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,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。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),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及时公告。

(六)风险收益特征
本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资品种,其预期风险与预期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,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,是股票型基金中处于中等风险水平的基金品种。

(七)基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法
1、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
2、有利于基金资产的安全与增值;
3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的人牟取任何不当利益。

(八)基金投资报告
基金管理人将定期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,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,保证报告中内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至 2018 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	47,436,077.87	90.67
	其中:股票	47,436,077.87	90.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,000.00	3.82
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,878,822.20	5.50
8	其他资产	3,311.60	0.01
9	合计	52,318,211.67	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1)报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	7,712.00	0.14
B	采矿业	1,611,585.00	3.10
C	制造业	18,827,602.53	36.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,314,066.00	2.52
E	建筑业	1,735,177.40	3.33
F	批发和零售业	898,554.00	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	1,324,823.00	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	2,305,536.70	4.43
J	金融业	16,364,326.20	31.44
K	房地产业	1,524,380.00	2.93
L	租赁和商务服务业	688,530.48	1.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	132,995.50	0.26
O	国民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	240,111.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	347,690.00	0.67
S	综合	-	-
合计		47,387,089.87	91.03

(2)报告期末非指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	48,988.00	0.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		48,988.00	0.09

(3)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通投资的股票。

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	601318	中国平安	48,200	3,301,700.00	6.34
2	600519	贵州茅台	2,400	1,752,000.00	3.37
3	600036	招商银行	46,600	1,430,154.00	2.75
4	601166	兴业银行	56,300	897,985.00	1.73
5	000033	美的集团	21,100	850,330.00	1.63
6	600016	民生银行	129,360	820,142.40	1.58
7	600887	伊利股份	28,400	729,312.00	1.40
8	601328	交通银行	124,500	727,080.00	1.40
9	600588	用友网络	24,650	685,763.00	1.32
10	601288	农业银行	173,500	674,915.00	1.30

(2)报告期末非指数投资按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

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	601118	海南橡胶	7,400	48,988.00	0.09

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、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策
本基金未参与投资股指期货。
10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1)本期国债期货投资政策
本基金未参与投资国债期货。
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
(3)本期国债期货投资评价
本基金未参与投资国债期货。

11 投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被

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、处罚的情形。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,495.23
2	应收证券清算款	2,410.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-927.17
5	应收中票款	332.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,311.60

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000033	美的集团	850,330.00	1.63	重大资产重组

②报告期末非指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601118	海南橡胶	48,988.00	0.09	重大资产重组

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
八、基金的业绩
基金业绩截止日为 2018 年 9 月 30 日。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。下述基金业绩指标不包括持有认购及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。

前海联合沪深 300

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
自基金合同生效以来至 2018 年 9 月 30 日	2.72%	0.84%	-3.22%	0.89%	5.94%	-0.05%

九、基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金银行汇划费用;
9、基金的开户费、期货账户开户费用、银行账户维护费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

上述基金费用由基金管理人按法律规定的范围参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.65%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.65%÷当年天数
H 为每日应计提的管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理人每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人