

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	11
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	14
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	32
7.1 期末基金资产组合情况 .....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
7.6 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 .....	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	60
7.8 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贵金属投资明细 .....	61

7.9 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 .....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	63
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF
基金主代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	149,892,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下, 可简称为“1000ETF”。

### 2.2 基金产品说明

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	本基金为被动式指数基金, 采用完全复制法, 按照成份股在标的指数中的基准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化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 1000 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund. com
客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	张海波	李建红

注:-

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-5,589,907.31
本期利润	-19,697,572.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1510
本期加权平均净值利润率	-19.55%
本期基金份额净值增长率	-18.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	-49,854,556.68
期末可供分配基金份额利润	-0.3326
期末基金资产净值	100,037,443.32
期末基金份额净值	0.6674
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-33.26%

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。

### 3.2 基金净值表现

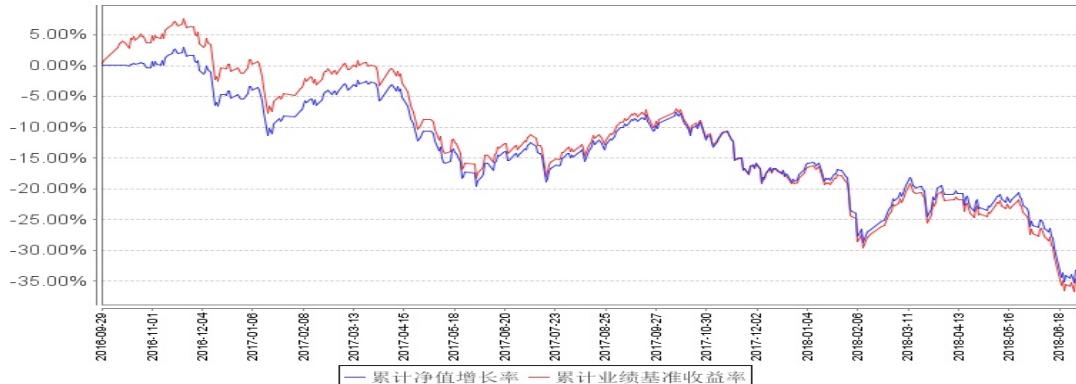
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-10.79%	1.97%	-11.19%	1.97%	0.40%	0.00%
过去三个月	-16.63%	1.45%	-17.51%	1.46%	0.88%	-0.01%

过去六个月	-18.83%	1.50%	-20.08%	1.50%	1.25%	0.00%
过去一年	-22.11%	1.26%	-24.88%	1.27%	2.77%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-33.26%	1.15%	-34.72%	1.17%	1.46%	-0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

南方中证1000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模近7,800亿元，旗下管理167只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

周豪	本基金基金经理	2016 年 9 月 29 日	-	9	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任数量化投资部高级研究员；2016 年 4 月至今，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至今，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至今，任 1000ETF 基金经理；2017 年 8 月至今，任南方有色金属基金经理；2017 年 9 月至今，任南方有色金属联接基金经理；2018 年 1 月至今，任南方中证 100 基金经理；2018 年 2 月至今，任南方消费活力基金经理。
----	---------	-----------------	---	---	---

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业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》等有关法律法规、中国证监会和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司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均未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内中证1000指数下跌20.08%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF现金流精算系统”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）申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；（2）报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。（3）根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓，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，将跟踪误差控制在理想范围内。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.6674元，报告期内，份额净值增长率为-18.83%，同期业绩基准增长率为-20.08%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观来看，国内经济增速预计平稳回落，企业盈利小幅下行，利率水平在外围美联储加息、内在降成本需求下，预计边际有所放松但空间不大，政策重点还是调结构、防风险。中美贸易冲突预计仍有反复，不过冲突继续扩大的可能性较小，且市场预期已较为充分，料相关因素影响将减弱。证券市场经过调整，风险得到一定释放，配置价值在提升，同时近期政策面也释放出积极信号，预计市场短期将迎来一定机会。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及

输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红方式；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金管理人

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,355,815.60	1,897,658.96
结算备付金		624,572.52	930,130.62
存出保证金		412,870.94	505,212.60
交易性金融资产	6.4.7.2	97,207,328.97	98,025,108.84
其中：股票投资		97,204,649.75	97,967,998.40
基金投资		—	—
债券投资		2,679.22	57,110.44
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	729.65	949.92
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		100,601,317.68	101,359,060.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		50,125.60	291.71
应付赎回款		—	—

应付管理人报酬		41,007.42	40,949.71
应付托管费		8,201.48	8,189.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,319.99	5,298.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	460,219.87	259,971.59
负债合计		563,874.36	314,701.77
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	149,892,000.00	122,892,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-49,854,556.68	-21,847,640.83
所有者权益合计		100,037,443.32	101,044,359.17
负债和所有者权益总计		100,601,317.68	101,359,060.94

注: 报告截止日 2018 年 06 月 30 日, 基金份额总额 149,892,000.00 份, 基金份额净值 0.6674 元。

## 6.2 利润表

会计主体: 南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年6月30日
<b>一、收入</b>		-19,043,899.42	-9,892,787.18
1. 利息收入		16,540.91	15,379.61
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	16,465.16	15,373.26
债券利息收入		75.75	6.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-5,090,109.72	-3,263,221.77
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-5,572,946.30	-3,725,788.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,589.69	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-152,520.00	26,160.00
股利收益	6.4.7.16	638,946.27	436,406.32

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	-14,107,665.63	-6,715,379.45
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 18	137,335.02	70,434.43
减: 二、费用		653,673.52	816,279.83
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	249,207.44	324,752.72
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	49,841.48	64,950.50
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	47,924.55	91,956.12
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	306,700.05	334,620.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-19,697,572.94	-10,709,067.01
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-19,697,572.94	-10,709,067.01

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金管理人

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	122,892,000.00	-21,847,640.83	101,044,359.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,697,572.94	-19,697,572.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	27,000,000.00	-8,309,342.91	18,690,657.09
其中: 1. 基金申购款	63,000,000.00	-15,349,243.46	47,650,756.54
2. 基金赎回款	-36,000,000.00	7,039,900.55	-28,960,099.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	149,892,000.00	-49,854,556.68	100,037,443.32
项目	上年度可比期间		

	2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	167,892,000.00	-9,083,512.67	158,808,487.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,709,067.01	-10,709,067.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-39,000,000.00	1,337,893.68	-37,662,106.32
其中：1.基金申购款	33,000,000.00	-2,726,579.17	30,273,420.83
2.基金赎回款	-72,000,000.00	4,064,472.85	-67,935,527.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	128,892,000.00	-18,454,686.00	110,437,314.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推进营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税

政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	2,355,815.60
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	2,355,815.60

#### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,455,942.25	97,204,649.75	-26,251,292.50
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,900.00	2,679.22
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	2,900.00	2,679.22
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	123,458,842.25	97,207,328.97	-26,251,513.28

注:于 2018 年 6 月 30 日, 股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 -1,126.60 元。

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

无。

##### 6.4.4.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	399.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	320.26
应收债券利息	3.91
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	—
其他	5.50
合计	729.65

#### 6.4.4.6 其他资产

无。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,319.99
银行间市场应付交易费用	—
合计	4,319.99

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应退替代款	155,924.32
预提费用	205,299.25
应付指数使用费	50,000.00
可退替代款	48,996.30
合计	460,219.87

注：1. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	122,892,000.00	122,892,000.00
本期申购	63,000,000.00	63,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-36,000,000.00	-36,000,000.00
本期末	149,892,000.00	149,892,000.00

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,222,345.32	-13,625,295.51	-21,847,640.83
本期利润	-5,589,907.31	-14,107,665.63	-19,697,572.94
本期基金份额交易产生的变动数	-2,459,979.72	-5,849,363.19	-8,309,342.91
其中：基金申购款	-5,202,340.18	-10,146,903.28	-15,349,243.46
基金赎回款	2,742,360.46	4,297,540.09	7,039,900.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,272,232.35	-33,582,324.33	-49,854,556.68

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	7,991.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,362.52
其他	111.44
合计	16,465.16

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,616,142.63
股票投资收益——赎回差价收入	-956,803.67
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,572,946.30

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日

卖出股票成交总额	32,799,400.13
减: 卖出股票成本总额	37,415,542.76
买卖股票差价收入	-4,616,142.63

#### 6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	28,960,099.45
减: 现金支付赎回款总额	19,671,331.45
减: 赎回股票成本总额	10,245,571.67
赎回差价收入	-956,803.67

#### 6.4.4.13 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	89,994.34
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	93,500.00
减: 应收利息总额	84.03
买卖债券差价收入	-3,589.69

#### 6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.4.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.4.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.4.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	638,946.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	638,946.27

#### 6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,890,785.63
股票投资	-13,892,454.41
债券投资	1,668.78
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-216,880.00
权证投资	-
期货	-216,880.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-14,107,665.63

注：本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益为-1,126.60元。

#### 6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	137,335.02
合计	137,335.02

注：1. 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

2. 其他为本基金网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息收入。

#### 6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	47,924.55
银行间市场交易费用	-
合计	47,924.55

#### 6.4.4.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	26,778.95
信息披露费	148,767.52
指数使用费	100,000.00
银行费用	1,400.80
上市费	29,752.78
合计	306,700.05

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》, 公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”, 公司股权结构等事项未发生变化, 并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	成交金额 占当期股票 成交总额的比例(%)	2017年1月1日至2017年6月30日	成交金额 占当期股票 成交总额的比例(%)
华泰证券	26,952,483.09	33.94	34,553,900.93	30.62

#### 6.4.7.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2018年1月1日至2018年6月30日			
当期 佣金	占当期佣金总量的 比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)	
华泰证券	2,690.09	33.90	2,384.70	55.20
关联方名称	上年度可比期间			
	2017年1月1日至2017年6月30日			
当期 佣金	占当期佣金总量的 比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)	
华泰证券	3,454.73	30.61	3,454.73	3.22

- 注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定, 以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	249,207.44	324,752.72
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.50%/当年天数。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	单位：人民币元	
		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	49,841.48	64,950.50	

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.7.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,355,815.60	7,991.20	1,920,892.63	7,475.37

注：本基金由基金托管人招商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

无。

### 6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000022	深赤湾A	2017-11-20	重大资产重组	22.82	2018-07-10	20.55	2,800	59,357.49	63,896.00	-
000035	中国天楹	2017-08-22	重大资产重组	6.72	2018-07-09	6.05	18,500	136,936.94	124,320.00	-
000038	深大通	2018-02-26	重大事项	18.10	-	-	2,660	71,650.69	48,146.00	-
000048	*ST康达	2018-05-02	实行退市风险警示公告	21.90	2018-07-02	20.81	7,600	204,347.11	166,440.00	-
000545	金浦钛业	2018-06-11	重大资产重组	3.76	-	-	17,200	93,303.62	64,672.00	-
000584	哈工智能	2018-03-29	重大资产重组	13.87	2018-07-16	12.48	10,200	140,941.86	141,474.00	-
000603	盛达矿业	2018-06-11	拟筹划重大资产重组	10.83	-	-	8,700	124,767.56	94,221.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大资产重组	18.08	-	-	3,900	80,216.76	70,512.00	-
000673	当代东方	2018-05-23	重大资产重组	18.34	2018-08-02	16.51	9,600	128,395.32	176,064.00	-
000711	京蓝科技	2018-03-26	重大事项	10.02	-	-	8,640	91,485.67	86,572.80	-
000796	凯撒旅游	2018-01-19	重大资产重组	12.90	2018-07-19	11.61	5,700	84,667.08	73,530.00	-
002053	云南能投	2018-05-28	重大资产重组	10.08	2018-07-13	9.07	5,500	64,641.39	55,440.00	-
002059	云南旅游	2018-03-26	重大资产重组	7.28	-	-	7,700	67,338.84	56,056.00	-
002086	东方海洋	2018-06-15	重大资产重组	6.68	-	-	11,000	114,762.26	73,480.00	-
002089	新海宜	2018-04-20	重大资产重组	6.05	2018-07-20	5.45	24,100	167,548.73	145,805.00	-
002102	冠福	2018-0	重大资产	4.07	-	-	51,600	245,890.13	210,012.00	-

	股份	6-01	重组								
002113	天润数娱	2018-02-01	重大事项	5.78	-	-	17,680	125,841.13	102,190.40	-	-
002121	科陆电子	2018-06-07	拟披露重大事项	6.49	2018-08-06	5.84	14,700	134,250.16	95,403.00	-	-
002171	楚江新材	2018-06-07	拟披露重大事项	6.78	-	-	11,000	85,127.86	74,580.00	-	-
002210	飞马国际	2018-03-26	拟披露重大事项	12.33	2018-08-13	11.07	16,170	188,764.10	199,376.10	-	-
002226	江南化工	2018-05-02	重大资产重组	5.42	-	-	9,600	70,796.37	52,032.00	-	-
002256	兆新股份	2018-03-02	重大事项	4.52	2018-07-02	4.07	18,700	118,427.13	84,524.00	-	-
002263	*ST东南	2018-02-26	重大资产重组	2.96	-	-	35,100	119,173.64	103,896.00	-	-
002301	齐心集团	2018-02-02	重大资产重组	10.50	2018-07-09	9.45	6,000	83,200.51	63,000.00	-	-
002436	兴森科技	2018-06-14	拟披露重大事项	4.29	-	-	29,600	184,238.50	126,984.00	-	-
002445	中南文化	2018-06-13	重大资产重组	8.44	-	-	12,200	170,080.25	102,968.00	-	-
002464	众应互联	2018-02-02	重大资产重组	21.19	2018-07-31	19.07	4,760	122,043.44	100,864.40	-	-
002502	骅威文化	2018-06-05	重大资产重组	5.82	-	-	11,300	105,291.10	65,766.00	-	-
002609	捷顺科技	2018-06-19	重大事项	9.52	2018-07-03	8.57	8,200	121,759.45	78,064.00	-	-
002610	爱康科技	2018-06-05	重大事项	2.10	-	-	92,400	254,775.11	194,040.00	-	-
002611	东方精工	2018-06-19	拟披露重大事项	6.17	2018-07-03	6.01	14,400	124,289.60	88,848.00	-	-
002617	露笑科技	2018-05-09	重大资产重组	8.15	-	-	13,350	137,763.68	108,802.50	-	-
002630	华西能源	2018-06-20	重大资产重组	6.54	-	-	24,460	183,837.93	159,968.40	-	-
002650	加加食品	2018-03-12	重大资产重组	4.86	-	-	17,000	122,398.22	82,620.00	-	-
002656	摩登大道	2018-06-19	拟披露重大事项	9.61	-	-	6,920	93,514.38	66,501.20	-	-
002668	奥马电器	2018-06-15	拟披露重大事项	20.10	-	-	9,680	218,013.11	194,568.00	-	-
002716	金贵银业	2018-05-03	重大资产重组	16.84	-	-	8,100	165,039.13	136,404.00	-	-

002721	金一文化	2018-05-29	重大资产重组	8.99	2018-07-09	8.35	10,300	153,212.99	92,597.00	-
002872	天圣制药	2018-04-03	重大资产重组	31.05	2018-07-03	27.95	1,500	45,760.00	46,575.00	-
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项	4.81	2018-07-03	5.20	15,150	114,976.90	72,871.50	-
300090	盛运环保	2018-06-04	拟披露重大事项	8.32	2018-07-02	7.49	23,600	246,485.22	196,352.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大资产重组	10.80	2018-08-07	9.63	11,000	149,449.49	118,800.00	-
300131	英唐智控	2018-05-29	重大资产重组	5.67	-	-	13,500	113,990.76	76,545.00	-
300198	纳川股份	2018-02-02	重大资产重组	5.99	2018-08-02	5.38	14,600	98,737.28	87,454.00	-
300229	拓尔思	2018-04-17	重大资产重组	15.88	2018-07-17	14.29	4,700	76,101.47	74,636.00	-
300238	冠昊生物	2018-02-02	重大资产重组	18.87	2018-07-18	16.98	5,100	173,615.79	96,237.00	-
300299	富春股份	2018-06-19	拟披露重大事项	4.67	2018-07-17	5.14	10,295	87,091.30	48,077.65	-
300317	珈伟股份	2018-02-05	重大资产重组	11.90	2018-07-03	10.71	7,993	152,116.01	95,116.70	-
300343	联创互联	2018-06-19	拟披露重大事项	10.00	-	-	7,700	122,738.13	77,000.00	-
300350	华鹏飞	2018-05-10	重大资产重组	8.13	2018-07-16	7.32	5,080	52,963.51	41,300.40	-
300362	天翔环境	2018-06-08	重大资产重组	9.68	-	-	4,700	68,498.77	45,496.00	-
600146	商赢环球	2018-06-19	重大资产重组	22.22	2018-08-15	20.00	5,900	145,181.00	131,098.00	-
600165	新日恒力	2018-02-13	重大事项	16.51	2018-07-05	14.86	10,000	141,839.76	165,100.00	-
600175	美都能源	2018-05-30	拟筹划重大资产重组	4.16	2018-08-17	3.74	51,700	260,435.39	215,072.00	-
600217	中再资环	2018-03-29	重大资产重组	6.13	-	-	17,300	120,228.24	106,049.00	-
600226	瀚叶股份	2017-11-28	重大资产重组	4.56	-	-	30,394	164,802.64	138,596.64	-
600318	新力金融	2018-03-23	重大资产重组	11.04	-	-	9,000	123,040.74	99,360.00	-
600399	抚顺特钢	2018-01-31	未及时披露定期报	5.50	-	-	20,900	135,191.72	114,950.00	-

			告								
600490	鹏欣资源	2018-04-16	重大资产重组	8.67	-	-	32,600	275,146.22	282,642.00	-	-
600641	万业企业	2018-04-17	拟筹划重大资产重组	12.18	2018-08-09	10.96	9,900	125,432.70	120,582.00	-	-
600764	中电广通	2018-04-16	拟筹划重大资产重组	31.77	-	-	3,800	116,109.64	120,726.00	-	-
600784	鲁银投资	2018-01-11	重大资产重组	5.46	2018-07-09	5.24	10,000	77,333.00	54,600.00	-	-
600800	天津磁卡	2018-05-21	拟筹划重大资产重组	5.47	-	-	12,900	97,108.41	70,563.00	-	-
603299	井神股份	2018-06-28	重要事项未公告	8.25	2018-07-05	8.48	7,400	87,579.21	61,050.00	-	-
603636	南威软件	2018-05-29	拟筹划重大资产重组	10.00	-	-	6,699	86,577.05	66,990.00	-	-
603939	益丰药房	2018-04-17	拟筹划重大资产重组	59.72	2018-07-16	65.69	3,700	155,606.44	220,964.00	-	-
603997	继峰股份	2018-05-30	拟筹划重大资产重组	10.87	-	-	4,500	57,782.38	48,915.00	-	-
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大资产重组	30.48	-	-	8,300	218,724.01	252,984.00	-	-
000967	盈峰环境	2018-05-18	重大事项	8.70	2018-07-31	8.01	11,990.00	110,970.95	104,313.00	-	-
002239	奥特佳	2018-04-02	重大事项	3.62	-	-	22,480.00	104,431.11	81,377.60	-	-

注:本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票, 该类股票将在所公布事项的重大影响消除后, 经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.10 金融工具风险及管理

##### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指型基金, 紧密跟踪中证 1000 指数, 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, 属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法, 跟踪中证 1000 指数, 以完全按照

标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资

产净值的比例为 0.0027%。

#### 6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

##### 6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

#### 6.4.10.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	2,355,815.60	-	-	-	2,355,815.60
结算备付金	624,572.52	-	-	-	624,572.52
存出保证金	12,198.94	-	-	400,672.00	412,870.94
交易性金融资产	2,679.22	-	-	97,204,649.75	97,207,328.97
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	729.65	729.65
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,995,266.28	-	-	97,606,051.40	100,601,317.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	41,007.42	41,007.42
应付托管费	-	-	-	8,201.48	8,201.48
应付证券清算款	-	-	-	50,125.60	50,125.60
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,319.99	4,319.99
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	460,219.87	460,219.87
负债总计	-	-	-	563,874.36	563,874.36
利率敏感度缺口	2,995,266.28	-	-	97,042,177.04	100,037,443.32
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,897,658.96	-	-	-	1,897,658.96
结算备付金	930,130.62	-	-	-	930,130.62
存出保证金	14,444.60	-	-	490,768.00	505,212.60
交易性金融资产	-	-	57,110.44	97,967,998.40	98,025,108.84
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	949.92	949.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,842,234.18	-	57,110.44	98,459,716.32	101,359,060.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	40,949.71	40,949.71
应付托管费	-	-	-	8,189.96	8,189.96

应付证券清算款	-	-	-	291.71	291.71
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,298.80	5,298.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	259,971.59	259,971.59
负债总计	-	-	-	314,701.77	314,701.77
利率敏感度缺口	2,842,234.18	-	57,110.44	98,145,014.55	101,044,359.17

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0027%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法,跟踪中证 1000 指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中,中证 1000 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	97,204,649.75	97.17	97,967,998.40	96.96
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	97,204,649.75	97.17	97,967,998.40	96.96

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准上升5%	4,244,224.96	5,053,995.69
	2. 业绩比较基准下降5%	-4,244,224.96	-5,053,995.69

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	97,204,649.75	96.62
	其中: 股票	97,204,649.75	96.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,679.22	0.00
	其中: 债券	2,679.22	0.00
	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	-	-
	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	2,980,388.12	2.96
8	其他各项资产	413,600.59	0.41

9	合计	100,601,317.68	100.00
---	----	----------------	--------

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	888,178.80	0.89
B	采矿业	2,269,020.16	2.27
C	制造业	61,854,308.06	61.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,320,267.63	2.32
E	建筑业	2,650,406.33	2.65
F	批发和零售业	4,139,456.26	4.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,277,029.60	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,885,129.24	9.88
J	金融业	388,415.00	0.39
K	房地产业	3,155,701.94	3.15
L	租赁和商务服务业	1,228,687.64	1.23
M	科学研究和技术服务业	985,433.90	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	1,116,857.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	963,711.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	1,676,691.14	1.68
S	综合	807,387.00	0.81
	合计	96,606,680.70	96.57

### 7.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	513,276.96	0.51
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	信息传输、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	居民服务、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	85,818.69	0.09
	合计	599,095.65	0.60

### 7.2.3 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投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300142	沃森生物	33,500	669,330.00	0.67
2	600779	水井坊	9,200	508,116.00	0.51
3	300347	泰格医药	8,200	507,334.00	0.51
4	300601	康泰生物	6,840	424,422.00	0.42
5	300168	万达信息	19,600	399,840.00	0.40
6	300176	鸿特科技	4,400	364,892.00	0.36
7	600567	山鹰纸业	87,100	336,206.00	0.34
8	002821	凯莱英	3,800	331,474.00	0.33
9	002507	涪陵榨菜	12,800	328,704.00	0.33
10	000735	罗牛山	25,100	324,292.00	0.32
11	600771	广誉远	5,800	318,768.00	0.32
12	002035	华帝股份	12,600	307,818.00	0.31
13	300170	汉得信息	18,900	306,936.00	0.31

14	601699	潞安环能	32,600	301,876.00	0.30
15	300009	安科生物	16,058	296,109.52	0.30
16	002680	ST长生	13,100	291,999.00	0.29
17	300450	先导智能	9,587	289,910.88	0.29
18	600486	扬农化工	5,100	285,243.00	0.29
19	600711	盛屯矿业	31,500	284,445.00	0.28
20	600490	鹏欣资源	32,600	282,642.00	0.28
21	002262	恩华药业	13,540	270,935.40	0.27
22	600702	沱牌舍得	7,500	270,675.00	0.27
23	002383	合众思壮	16,100	266,455.00	0.27
24	002185	华天科技	46,100	260,004.00	0.26
25	000040	东旭蓝天	25,300	255,530.00	0.26
26	300271	华宇软件	14,400	254,592.00	0.25
27	600745	闻泰科技	8,300	252,984.00	0.25
28	002372	伟星新材	14,296	252,896.24	0.25
29	600763	通策医疗	5,100	248,217.00	0.25
30	300413	芒果超媒	6,500	246,610.00	0.25
31	002138	顺络电子	15,400	246,554.00	0.25
32	300558	贝达药业	4,400	244,948.00	0.24
33	300616	尚品宅配	2,240	244,160.00	0.24
34	600252	中恒集团	75,100	243,324.00	0.24
35	300285	国瓷材料	12,200	243,268.00	0.24
36	300073	当升科技	7,100	241,826.00	0.24
37	002341	新纶科技	18,000	239,220.00	0.24
38	300316	晶盛机电	17,530	232,973.70	0.23
39	601799	星宇股份	3,800	227,582.00	0.23
40	000989	九芝堂	11,800	223,020.00	0.22
41	300203	聚光科技	8,700	222,720.00	0.22
42	603939	益丰药房	3,700	220,964.00	0.22
43	002497	雅化集团	20,700	218,178.00	0.22
44	000831	五矿稀土	18,630	216,853.20	0.22
45	000717	韶钢松山	32,900	215,824.00	0.22
46	600175	美都能源	51,700	215,072.00	0.21
47	002376	新北洋	12,700	210,058.00	0.21
48	002102	冠福股份	51,600	210,012.00	0.21
49	300226	上海钢联	3,500	209,475.00	0.21
50	000683	远兴能源	73,900	209,137.00	0.21
51	600507	方大特钢	19,300	206,317.00	0.21
52	000591	太阳能	56,240	205,838.40	0.21
53	300012	华测检测	35,800	205,492.00	0.21
54	300355	蒙草生态	34,140	205,181.40	0.21
55	000516	国际医学	42,800	205,012.00	0.20

56	002023	海特高新	16,300	204,402.00	0.20
57	300014	亿纬锂能	11,476	201,977.60	0.20
58	600797	浙大网新	20,000	201,800.00	0.20
59	002727	一心堂	6,200	201,190.00	0.20
60	002210	飞马国际	16,170	199,376.10	0.20
61	300618	寒锐钴业	1,540	197,643.60	0.20
62	300090	盛运环保	23,600	196,352.00	0.20
63	600740	山西焦化	19,100	196,348.00	0.20
64	300036	超图软件	9,600	195,744.00	0.20
65	002343	慈文传媒	10,420	195,583.40	0.20
66	002668	奥马电器	9,680	194,568.00	0.19
67	300496	中科创达	6,600	194,502.00	0.19
68	002610	爱康科技	92,400	194,040.00	0.19
69	600782	新钢股份	34,500	192,510.00	0.19
70	300463	迈克生物	7,700	191,961.00	0.19
71	601636	旗滨集团	43,100	191,795.00	0.19
72	300188	美亚柏科	10,480	191,784.00	0.19
73	600323	瀚蓝环境	12,600	191,772.00	0.19
74	002419	天虹股份	13,100	191,260.00	0.19
75	600728	佳都科技	26,200	190,998.00	0.19
76	600803	新奥股份	16,500	190,410.00	0.19
77	300098	高新兴	23,620	188,487.60	0.19
78	300207	欣旺达	20,900	188,309.00	0.19
79	600320	振华重工	44,900	188,131.00	0.19
80	600675	中华企业	38,300	188,053.00	0.19
81	002597	金禾实业	9,200	186,576.00	0.19
82	600132	重庆啤酒	6,600	182,754.00	0.18
83	600273	嘉化能源	20,100	182,106.00	0.18
84	600185	格力地产	33,500	181,905.00	0.18
85	002042	华孚时尚	24,300	180,792.00	0.18
86	600559	老白干酒	9,040	180,709.60	0.18
87	002596	海南瑞泽	17,600	180,576.00	0.18
88	603678	火炬电子	7,200	179,424.00	0.18
89	000059	华锦股份	25,900	178,451.00	0.18
90	000917	电广传媒	30,600	176,256.00	0.18
91	000673	当代东方	9,600	176,064.00	0.18
92	600562	国睿科技	10,210	175,101.50	0.18
93	000818	航锦科技	15,000	174,450.00	0.17
94	000697	炼石有色	12,100	173,756.00	0.17
95	002151	北斗星通	6,700	172,190.00	0.17
96	000799	酒鬼酒	6,200	172,050.00	0.17
97	300367	东方网力	13,700	171,250.00	0.17

98	300077	国民技术	15,200	169,024.00	0.17
99	600667	太极实业	22,900	168,544.00	0.17
100	300037	新宙邦	6,200	166,098.00	0.17
101	000800	一汽轿车	22,200	166,056.00	0.17
102	002511	中顺洁柔	17,595	165,744.90	0.17
103	600165	新日恒力	10,000	165,100.00	0.17
104	300180	华峰超纤	15,240	165,049.20	0.16
105	300628	亿联网络	2,500	164,775.00	0.16
106	000902	新洋丰	17,800	163,760.00	0.16
107	002313	日海智能	6,800	162,724.00	0.16
108	000150	宜华健康	6,000	162,600.00	0.16
109	600868	梅雁吉祥	51,600	162,540.00	0.16
110	600197	伊力特	7,200	162,360.00	0.16
111	600110	诺德股份	31,000	162,130.00	0.16
112	300482	万孚生物	2,306	161,420.00	0.16
113	002614	奥佳华	7,800	161,382.00	0.16
114	300377	赢时胜	11,850	161,041.50	0.16
115	000968	蓝焰控股	15,400	160,006.00	0.16
116	002630	华西能源	24,460	159,968.40	0.16
117	300476	胜宏科技	10,360	159,544.00	0.16
118	000507	珠海港	17,000	159,460.00	0.16
119	300054	鼎龙股份	18,280	159,401.60	0.16
120	002501	利源精制	25,700	159,340.00	0.16
121	002108	沧州明珠	27,089	159,012.43	0.16
122	000016	深康佳A	30,200	158,550.00	0.16
123	002025	航天电器	6,800	157,080.00	0.16
124	601918	新集能源	41,600	156,416.00	0.16
125	300053	欧比特	13,400	155,440.00	0.16
126	002537	海联金汇	16,440	155,193.60	0.16
127	300459	金科文化	15,900	153,594.00	0.15
128	002402	和而泰	18,450	153,135.00	0.15
129	600756	浪潮软件	8,900	152,724.00	0.15
130	300145	中金环境	19,500	152,685.00	0.15
131	000836	鑫茂科技	32,300	152,456.00	0.15
132	002812	创新股份	3,100	152,303.00	0.15
133	600446	金证股份	13,800	151,938.00	0.15
134	300149	量子生物	9,200	151,616.00	0.15
135	000869	张裕A	3,800	151,468.00	0.15
136	002095	生意宝	4,200	150,738.00	0.15
137	300137	先河环保	9,400	150,212.00	0.15
138	300222	科大智能	8,100	150,174.00	0.15
139	300529	健帆生物	3,500	150,115.00	0.15

140	601588	北辰实业	42,600	149,952.00	0.15
141	300323	华灿光电	11,600	149,872.00	0.15
142	600856	中天能源	23,100	148,764.00	0.15
143	603399	新华龙	8,800	148,720.00	0.15
144	300101	振芯科技	10,500	148,365.00	0.15
145	600330	天通股份	21,640	148,234.00	0.15
146	002421	达实智能	36,600	148,230.00	0.15
147	000933	神火股份	30,800	148,148.00	0.15
148	000650	仁和药业	23,200	147,552.00	0.15
149	300294	博雅生物	4,750	147,202.50	0.15
150	002130	沃尔核材	33,600	146,496.00	0.15
151	000710	贝瑞基因	2,900	146,044.00	0.15
152	600057	象屿股份	29,246	145,937.54	0.15
153	300373	扬杰科技	5,100	145,860.00	0.15
154	600230	沧州大化	6,580	145,812.80	0.15
155	002089	新海宜	24,100	145,805.00	0.15
156	000537	广宇发展	15,100	145,564.00	0.15
157	601100	恒立液压	6,960	145,324.80	0.15
158	600200	江苏吴中	19,200	144,768.00	0.14
159	300409	道氏技术	3,600	144,396.00	0.14
160	603517	绝味食品	3,400	144,330.00	0.14
161	300212	易华录	6,100	144,265.00	0.14
162	002449	国星光电	13,550	144,172.00	0.14
163	300068	南都电源	11,900	142,562.00	0.14
164	300208	恒顺众昇	14,500	142,245.00	0.14
165	000034	神州数码	8,900	142,222.00	0.14
166	601058	赛轮金宇	58,500	142,155.00	0.14
167	600337	美克家居	24,200	141,812.00	0.14
168	000584	哈工智能	10,200	141,474.00	0.14
169	300568	星源材质	3,700	141,377.00	0.14
170	300237	美晨生态	19,660	141,158.80	0.14
171	601222	林洋能源	28,300	140,934.00	0.14
172	600206	有研新材	15,900	140,715.00	0.14
173	300079	数码科技	38,600	140,504.00	0.14
174	300699	光威复材	3,100	140,120.00	0.14
175	002020	京新药业	11,800	139,004.00	0.14
176	600477	杭萧钢构	29,017	138,991.43	0.14
177	002126	银轮股份	15,400	138,908.00	0.14
178	600226	瀚叶股份	30,394	138,596.64	0.14
179	002389	南洋科技	10,200	138,108.00	0.14
180	600990	四创电子	2,800	138,096.00	0.14
181	000088	盐田港	20,900	137,731.00	0.14

182	002156	通富微电	12,700	137,541.00	0.14
183	300038	梅泰诺	12,900	137,514.00	0.14
184	000739	普洛药业	19,200	137,472.00	0.14
185	002258	利尔化学	7,100	137,456.00	0.14
186	002716	金贵银业	8,100	136,404.00	0.14
187	600239	云南城投	30,350	136,271.50	0.14
188	002099	海翔药业	26,400	135,432.00	0.14
189	300567	精测电子	1,700	135,320.00	0.14
190	002036	联创电子	10,300	135,136.00	0.14
191	300020	银江股份	14,200	135,042.00	0.13
192	002737	葵花药业	6,200	134,106.00	0.13
193	002550	千红制药	23,900	133,601.00	0.13
194	603660	苏州科达	5,880	133,182.00	0.13
195	600622	光大嘉宝	18,516	133,130.04	0.13
196	002664	长鹰信质	5,300	133,030.00	0.13
197	600742	一汽富维	10,860	132,817.80	0.13
198	002237	恒邦股份	14,500	132,385.00	0.13
199	002091	江苏国泰	20,830	132,270.50	0.13
200	601666	平煤股份	31,600	132,088.00	0.13
201	600146	商赢环球	5,900	131,098.00	0.13
202	601929	吉视传媒	58,000	130,500.00	0.13
203	000875	吉电股份	46,000	130,180.00	0.13
204	000910	大亚圣象	7,700	130,130.00	0.13
205	002240	威华股份	10,000	130,000.00	0.13
206	300309	吉艾科技	6,400	129,792.00	0.13
207	600269	赣粤高速	31,700	129,653.00	0.13
208	600123	兰花科创	18,600	129,642.00	0.13
209	002292	奥飞娱乐	14,500	129,485.00	0.13
210	600612	老凤祥	3,600	129,384.00	0.13
211	600789	鲁抗医药	12,800	128,896.00	0.13
212	600322	天房发展	23,600	128,856.00	0.13
213	600851	海欣股份	15,600	128,232.00	0.13
214	600568	中珠医疗	26,700	128,160.00	0.13
215	000036	华联控股	21,500	127,710.00	0.13
216	002675	东诚药业	12,500	127,375.00	0.13
217	600708	光明地产	29,604	127,297.20	0.13
218	002747	埃斯顿	9,100	127,218.00	0.13
219	000546	金圆股份	9,500	127,015.00	0.13
220	600577	精达股份	36,600	127,002.00	0.13
221	002436	兴森科技	29,600	126,984.00	0.13
222	002047	宝鹰股份	21,600	126,576.00	0.13
223	300185	通裕重工	69,900	126,519.00	0.13

224	000921	海信科龙	12,200	126,392.00	0.13
225	603718	海利生物	8,800	126,368.00	0.13
226	000676	智度股份	10,200	126,276.00	0.13
227	002157	正邦科技	31,000	126,170.00	0.13
228	300078	思创医惠	13,220	125,325.60	0.13
229	300102	乾照光电	19,100	125,296.00	0.13
230	000767	漳泽电力	49,100	125,205.00	0.13
231	002145	中核钛白	33,900	124,752.00	0.12
232	000035	中国天楹	18,500	124,320.00	0.12
233	000576	广东甘化	7,000	124,180.00	0.12
234	002327	富安娜	11,400	123,576.00	0.12
235	600966	博汇纸业	28,500	122,835.00	0.12
236	300091	金通灵	8,900	122,820.00	0.12
237	601908	京运通	26,800	122,744.00	0.12
238	600420	现代制药	11,800	122,720.00	0.12
239	600172	黄河旋风	28,240	122,561.60	0.12
240	601011	宝泰隆	21,600	122,472.00	0.12
241	002697	红旗连锁	25,300	122,452.00	0.12
242	600546	山煤国际	27,400	122,204.00	0.12
243	300348	长亮科技	4,400	122,188.00	0.12
244	300085	银之杰	9,400	122,012.00	0.12
245	002293	罗莱生活	8,100	121,743.00	0.12
246	002429	兆驰股份	49,000	121,520.00	0.12
247	603368	柳州医药	3,592	121,337.76	0.12
248	600986	科达股份	12,900	120,744.00	0.12
249	600764	中电广通	3,800	120,726.00	0.12
250	600641	万业企业	9,900	120,582.00	0.12
251	002222	福晶科技	9,200	119,968.00	0.12
252	000733	振华科技	9,000	119,790.00	0.12
253	002245	澳洋顺昌	18,500	119,695.00	0.12
254	002067	景兴纸业	30,500	119,560.00	0.12
255	300178	腾邦国际	8,500	119,510.00	0.12
256	603323	吴江银行	19,300	119,081.00	0.12
257	002192	融捷股份	4,900	118,825.00	0.12
258	300118	东方日升	11,000	118,800.00	0.12
259	600845	宝信软件	4,500	118,575.00	0.12
260	603686	龙马环卫	4,800	117,312.00	0.12
261	000901	航天科技	11,700	117,234.00	0.12
262	600114	东睦股份	11,972	116,966.44	0.12
263	000882	华联股份	44,400	116,772.00	0.12
264	300339	润和软件	10,700	116,202.00	0.12
265	002618	丹邦科技	10,150	116,116.00	0.12

266	002387	维信诺	10,800	116,100.00	0.12
267	000687	华讯方舟	12,600	116,046.00	0.12
268	600621	华鑫股份	11,400	115,938.00	0.12
269	601069	西部黄金	6,900	115,851.00	0.12
270	600285	羚锐制药	13,000	115,830.00	0.12
271	300369	绿盟科技	10,800	115,560.00	0.12
272	300047	天源迪科	7,400	115,440.00	0.12
273	600693	东百集团	19,200	115,008.00	0.11
274	002430	杭氧股份	8,000	114,640.00	0.11
275	600491	龙元建设	16,400	114,636.00	0.11
276	600162	香江控股	45,100	113,652.00	0.11
277	002097	山河智能	17,357	113,514.78	0.11
278	000155	川化股份	20,200	113,322.00	0.11
279	603708	家家悦	5,140	113,028.60	0.11
280	002626	金达威	6,500	112,775.00	0.11
281	600033	福建高速	37,300	112,646.00	0.11
282	601369	陕鼓动力	17,600	112,640.00	0.11
283	002203	海亮股份	13,900	112,590.00	0.11
284	000688	国城矿业	9,300	112,251.00	0.11
285	600668	尖峰集团	9,200	112,240.00	0.11
286	300177	中海达	8,600	111,800.00	0.11
287	300474	景嘉微	2,400	111,552.00	0.11
288	600988	赤峰黄金	22,900	111,523.00	0.11
289	300352	北信源	27,600	111,504.00	0.11
290	600502	安徽水利	27,600	110,952.00	0.11
291	600067	冠城大通	27,900	110,763.00	0.11
292	300300	汉鼎宇佑	6,100	110,593.00	0.11
293	600720	祁连山	16,400	110,536.00	0.11
294	600681	百川能源	8,500	110,160.00	0.11
295	601003	柳钢股份	13,900	110,088.00	0.11
296	600326	西藏天路	18,520	109,453.20	0.11
297	000789	万年青	10,000	109,400.00	0.11
298	002433	太安堂	14,600	109,208.00	0.11
299	600210	紫江企业	32,400	109,188.00	0.11
300	002061	浙江交科	10,400	108,888.00	0.11
301	002617	露笑科技	13,350	108,802.50	0.11
302	002643	万润股份	14,550	108,688.50	0.11
303	600076	康欣新材	22,600	108,480.00	0.11
304	002303	美盈森	20,500	108,240.00	0.11
305	002139	拓邦股份	19,000	108,110.00	0.11
306	600255	梦舟股份	48,000	107,520.00	0.11
307	600072	中船科技	11,700	107,172.00	0.11

308	600133	东湖高新	12,700	106,934.00	0.11
309	600400	红豆股份	28,420	106,575.00	0.11
310	300431	暴风集团	7,020	106,563.60	0.11
311	600217	中再资环	17,300	106,049.00	0.11
312	002717	岭南股份	10,790	105,849.90	0.11
313	002043	兔宝宝	13,800	105,708.00	0.11
314	002104	恒宝股份	15,516	105,663.96	0.11
315	600116	三峡水利	15,800	105,544.00	0.11
316	000429	粤高速A	14,600	105,412.00	0.11
317	600707	彩虹股份	14,900	105,194.00	0.11
318	600290	华仪电气	10,200	104,958.00	0.10
319	600581	八一钢铁	20,300	104,951.00	0.10
320	000555	神州信息	7,900	104,912.00	0.10
321	600129	太极集团	7,700	104,797.00	0.10
322	002462	嘉事堂	5,400	104,760.00	0.10
323	002031	巨轮智能	47,900	104,422.00	0.10
324	000967	盈峰环境	11,990	104,313.00	0.10
325	000851	高鸿股份	19,380	104,264.40	0.10
326	600686	金龙汽车	8,300	103,667.00	0.10
327	600638	新黄浦	7,700	103,411.00	0.10
328	300298	三诺生物	5,000	103,400.00	0.10
329	000525	红太阳	6,100	103,395.00	0.10
330	002531	天顺风能	23,700	103,095.00	0.10
331	002215	诺普信	14,800	103,008.00	0.10
332	002445	中南文化	12,200	102,968.00	0.10
333	603008	喜临门	5,200	102,856.00	0.10
334	000915	山大华特	5,110	102,762.10	0.10
335	300467	迅游科技	3,200	102,720.00	0.10
336	000810	创维数字	11,300	102,604.00	0.10
337	000055	方大集团	18,250	102,565.00	0.10
338	600846	同济科技	13,600	102,408.00	0.10
339	002113	天润数娱	17,680	102,190.40	0.10
340	002094	青岛金王	11,260	101,452.60	0.10
341	002649	博彦科技	11,100	101,232.00	0.10
342	300236	上海新阳	3,300	101,079.00	0.10
343	002464	众应互联	4,760	100,864.40	0.10
344	600075	新疆天业	15,500	100,750.00	0.10
345	600360	华微电子	15,900	100,488.00	0.10
346	002055	得润电子	6,300	100,485.00	0.10
347	002320	海峡股份	5,300	100,435.00	0.10
348	000030	富奥股份	13,500	100,170.00	0.10
349	600569	安阳钢铁	25,400	100,076.00	0.10

350	600531	豫光金铅	20,200	99,788.00	0.10
351	000822	山东海化	14,300	99,671.00	0.10
352	002117	东港股份	6,700	99,361.00	0.10
353	600318	新力金融	9,000	99,360.00	0.10
354	601388	怡球资源	39,400	99,288.00	0.10
355	002488	金固股份	9,200	99,268.00	0.10
356	300666	江丰电子	1,800	99,234.00	0.10
357	000952	广济药业	6,900	99,153.00	0.10
358	000751	锌业股份	30,400	99,104.00	0.10
359	603588	高能环境	10,500	98,490.00	0.10
360	600331	宏达股份	38,000	98,420.00	0.10
361	300523	辰安科技	1,580	98,402.40	0.10
362	603338	浙江鼎力	2,120	98,368.00	0.10
363	300157	恒泰艾普	15,100	98,150.00	0.10
364	600227	赤天化	26,100	98,136.00	0.10
365	603337	杰克股份	2,520	97,952.40	0.10
366	300406	九强生物	6,800	97,920.00	0.10
367	600512	腾达建设	43,400	97,650.00	0.10
368	000797	中国武夷	14,100	97,572.00	0.10
369	002206	海利得	19,550	97,554.50	0.10
370	300458	全志科技	5,408	96,911.36	0.10
371	600963	岳阳林纸	18,700	96,866.00	0.10
372	002016	世荣兆业	6,400	96,448.00	0.10
373	002447	晨鑫科技	28,200	96,444.00	0.10
374	000672	上峰水泥	10,700	96,407.00	0.10
375	600987	航民股份	10,200	96,390.00	0.10
376	600343	航天动力	10,500	96,390.00	0.10
377	300238	冠昊生物	5,100	96,237.00	0.10
378	300128	锦富技术	24,605	95,959.50	0.10
379	002581	未名医药	9,000	95,850.00	0.10
380	300219	鸿利智汇	9,900	95,832.00	0.10
381	002318	久立特材	15,900	95,718.00	0.10
382	002279	久其软件	9,630	95,433.30	0.10
383	002121	科陆电子	14,700	95,403.00	0.10
384	300310	宜通世纪	14,940	95,317.20	0.10
385	300183	东软载波	6,200	95,294.00	0.10
386	300317	珈伟股份	7,993	95,116.70	0.10
387	600812	华北制药	21,900	95,046.00	0.10
388	002711	欧浦智网	11,320	94,861.60	0.09
389	002510	天汽模	20,000	94,600.00	0.09
390	300495	美尚生态	8,150	94,540.00	0.09
391	000951	中国重汽	7,100	94,359.00	0.09

392	600020	中原高速	25,000	94,250.00	0.09
393	000603	盛达矿业	8,700	94,221.00	0.09
394	002443	金洲管道	13,900	93,964.00	0.09
395	000571	新大洲A	22,200	93,240.00	0.09
396	300457	赢合科技	4,050	93,190.50	0.09
397	000935	四川双马	6,000	92,880.00	0.09
398	600093	易见股份	9,200	92,736.00	0.09
399	002564	天沃科技	16,400	92,660.00	0.09
400	002721	金一文化	10,300	92,597.00	0.09
401	002677	浙江美大	5,300	92,220.00	0.09
402	603096	新经典	1,100	92,158.00	0.09
403	300083	劲胜智能	19,100	92,062.00	0.09
404	002474	榕基软件	11,600	91,988.00	0.09
405	600261	阳光照明	24,400	91,744.00	0.09
406	300075	数字政通	6,800	91,732.00	0.09
407	600391	航发科技	6,300	91,665.00	0.09
408	002467	二六三	16,900	91,598.00	0.09
409	002448	中原内配	13,100	91,307.00	0.09
410	600997	开滦股份	17,400	91,176.00	0.09
411	000976	华铁股份	17,500	91,175.00	0.09
412	002684	猛狮科技	7,700	90,706.00	0.09
413	600684	珠江实业	16,060	90,578.40	0.09
414	300429	强力新材	3,100	90,520.00	0.09
415	300288	朗玛信息	5,500	90,420.00	0.09
416	300398	飞凯材料	4,600	89,976.00	0.09
417	600090	同济堂	15,800	89,902.00	0.09
418	300364	中文在线	12,756	89,802.24	0.09
419	002859	洁美科技	2,300	89,585.00	0.09
420	603881	数据港	2,300	89,332.00	0.09
421	603308	应流股份	6,900	89,286.00	0.09
422	603111	康尼机电	13,500	89,235.00	0.09
423	600604	市北高新	18,800	89,112.00	0.09
424	300044	赛为智能	12,620	88,971.00	0.09
425	002326	永太科技	12,801	88,966.95	0.09
426	002611	东方精工	14,400	88,848.00	0.09
427	600363	联创光电	9,600	88,704.00	0.09
428	300349	金卡智能	4,600	88,504.00	0.09
429	000996	中国中期	9,250	88,430.00	0.09
430	002586	围海股份	12,600	88,200.00	0.09
431	002867	周大生	2,800	88,172.00	0.09
432	002582	好想你	8,100	88,047.00	0.09
433	000828	东莞控股	11,000	87,780.00	0.09

434	300198	纳川股份	14,600	87,454.00	0.09
435	000918	嘉凯城	19,200	87,360.00	0.09
436	600495	晋西车轴	22,700	87,168.00	0.09
437	002622	融钰集团	18,000	87,120.00	0.09
438	300292	吴通控股	23,800	87,108.00	0.09
439	300353	东土科技	6,800	86,972.00	0.09
440	000881	中广核技	8,700	86,913.00	0.09
441	002080	中材科技	10,220	86,870.00	0.09
442	000889	茂业通信	6,800	86,768.00	0.09
443	000820	神雾节能	10,300	86,726.00	0.09
444	000711	京蓝科技	8,640	86,572.80	0.09
445	603367	辰欣药业	3,700	86,469.00	0.09
446	002204	大连重工	21,500	86,430.00	0.09
447	300031	宝通科技	6,300	86,310.00	0.09
448	002484	江海股份	13,190	86,262.60	0.09
449	300224	正海磁材	10,800	85,428.00	0.09
450	000928	中钢国际	16,800	85,176.00	0.09
451	300438	鹏辉能源	4,400	84,964.00	0.08
452	300284	苏交科	10,680	84,692.40	0.08
453	002912	中新赛克	900	84,600.00	0.08
454	002256	兆新股份	18,700	84,524.00	0.08
455	000520	长航凤凰	27,600	84,456.00	0.08
456	600508	上海能源	7,900	84,372.00	0.08
457	600069	银鸽投资	21,300	84,348.00	0.08
458	600550	保变电气	20,700	84,249.00	0.08
459	300439	美康生物	3,900	84,240.00	0.08
460	000973	佛塑科技	21,700	84,196.00	0.08
461	300130	新国都	6,240	84,177.60	0.08
462	601163	三角轮胎	6,300	84,168.00	0.08
463	300607	拓斯达	1,400	84,168.00	0.08
464	600456	宝钛股份	5,800	84,100.00	0.08
465	000731	四川美丰	16,000	84,000.00	0.08
466	002283	天润曲轴	21,200	83,952.00	0.08
467	601139	深圳燃气	15,120	83,916.00	0.08
468	601101	昊华能源	12,900	83,850.00	0.08
469	002229	鸿博股份	9,400	83,660.00	0.08
470	600063	皖维高新	31,100	83,659.00	0.08
471	000802	北京文化	8,000	83,520.00	0.08
472	002585	双星新材	15,620	83,410.80	0.08
473	002756	永兴特钢	4,800	83,376.00	0.08
474	000582	北部湾港	11,000	83,270.00	0.08
475	600602	云赛智联	14,300	82,940.00	0.08

476	603128	华贸物流	14,200	82,786.00	0.08
477	002650	加加食品	17,000	82,620.00	0.08
478	300232	洲明科技	8,360	82,596.80	0.08
479	002362	汉王科技	4,100	82,492.00	0.08
480	002557	洽洽食品	5,400	82,350.00	0.08
481	600382	广东明珠	7,800	82,290.00	0.08
482	603233	大参林	1,200	82,152.00	0.08
483	002413	雷科防务	15,200	81,928.00	0.08
484	002267	陕天然气	11,700	81,900.00	0.08
485	600055	万东医疗	7,400	81,696.00	0.08
486	002167	东方锆业	13,300	81,662.00	0.08
487	600677	航天通信	10,100	81,507.00	0.08
488	300336	新文化	10,000	81,500.00	0.08
489	300393	中来股份	2,800	81,424.00	0.08
490	002239	奥特佳	22,480	81,377.60	0.08
491	300379	东方通	5,300	81,143.00	0.08
492	600676	交运股份	16,300	81,011.00	0.08
493	600231	凌钢股份	22,940	80,978.20	0.08
494	002522	浙江众成	12,500	80,875.00	0.08
495	002307	北新路桥	14,640	80,812.80	0.08
496	300485	赛升药业	5,600	80,584.00	0.08
497	600180	瑞茂通	8,300	80,427.00	0.08
498	300065	海兰信	5,700	80,256.00	0.08
499	000615	京汉股份	12,700	79,883.00	0.08
500	600136	当代明诚	6,600	79,860.00	0.08
501	600303	曙光股份	14,600	79,716.00	0.08
502	600783	鲁信创投	8,200	79,212.00	0.08
503	300110	华仁药业	16,660	79,135.00	0.08
504	300388	国祯环保	4,100	79,007.00	0.08
505	300506	名家汇	3,800	78,774.00	0.08
506	002197	证通电子	9,600	78,720.00	0.08
507	600405	动力源	15,373	78,709.76	0.08
508	002542	中化岩土	14,700	78,498.00	0.08
509	000639	西王食品	6,100	78,263.00	0.08
510	002609	捷顺科技	8,200	78,064.00	0.08
511	600054	黄山旅游	6,700	78,055.00	0.08
512	002481	双塔食品	17,200	77,744.00	0.08
513	603026	石大胜华	3,400	77,656.00	0.08
514	300223	北京君正	3,399	77,497.20	0.08
515	601952	苏垦农发	11,410	77,473.90	0.08
516	300096	易联众	9,200	77,464.00	0.08
517	002562	兄弟科技	11,520	77,299.20	0.08

518	300343	联创互联	7,700	77,000.00	0.08
519	603579	荣泰健康	1,100	76,956.00	0.08
520	300045	华力创通	8,300	76,941.00	0.08
521	002367	康力电梯	12,900	76,884.00	0.08
522	300424	航新科技	3,955	76,806.10	0.08
523	000601	韶能股份	17,491	76,785.49	0.08
524	002547	春兴精工	17,600	76,560.00	0.08
525	300131	英唐智控	13,500	76,545.00	0.08
526	603387	基蛋生物	1,500	76,170.00	0.08
527	000560	我爱我家	13,430	76,013.80	0.08
528	000957	中通客车	11,100	75,924.00	0.08
529	300007	汉威科技	6,000	75,840.00	0.08
530	603989	艾华集团	3,350	75,274.50	0.08
531	002224	三力士	12,600	75,096.00	0.08
532	300184	力源信息	7,000	75,040.00	0.08
533	300229	拓尔思	4,700	74,636.00	0.07
534	300242	佳云科技	10,600	74,624.00	0.07
535	002247	帝龙文化	9,100	74,620.00	0.07
536	002171	楚江新材	11,000	74,580.00	0.07
537	002364	中恒电气	7,700	74,536.00	0.07
538	603393	新天然气	2,200	74,536.00	0.07
539	002833	弘亚数控	1,400	74,410.00	0.07
540	600590	泰豪科技	11,510	74,239.50	0.07
541	002409	雅克科技	3,800	74,100.00	0.07
542	600084	中葡股份	18,400	73,600.00	0.07
543	002079	苏州固锝	11,700	73,593.00	0.07
544	600552	凯盛科技	16,500	73,590.00	0.07
545	002453	华软科技	12,400	73,532.00	0.07
546	000796	凯撒旅游	5,700	73,530.00	0.07
547	002086	东方海洋	11,000	73,480.00	0.07
548	000795	英洛华	15,600	73,476.00	0.07
549	603898	好莱客	2,800	73,472.00	0.07
550	300278	华昌达	8,100	73,467.00	0.07
551	002305	南国置业	24,300	73,386.00	0.07
552	000958	东方能源	20,800	73,216.00	0.07
553	600480	凌云股份	7,600	73,112.00	0.07
554	300231	银信科技	9,600	72,960.00	0.07
555	300008	天海防务	15,150	72,871.50	0.07
556	600105	永鼎股份	19,980	72,727.20	0.07
557	002115	三维通信	8,900	72,713.00	0.07
558	002253	川大智胜	5,000	72,550.00	0.07
559	000801	四川九洲	16,200	72,414.00	0.07

560	300456	耐威科技	3,200	72,320.00	0.07
561	002695	煌上煌	5,400	72,252.00	0.07
562	300252	金信诺	7,950	72,106.50	0.07
563	600096	云天化	14,300	72,072.00	0.07
564	600103	青山纸业	24,100	72,059.00	0.07
565	601599	鹿港文化	17,700	72,039.00	0.07
566	002751	易尚展示	2,300	71,967.00	0.07
567	000936	华西股份	11,800	71,862.00	0.07
568	002178	延华智能	11,200	71,680.00	0.07
569	600106	重庆路桥	23,884	71,652.00	0.07
570	002255	海陆重工	13,800	71,484.00	0.07
571	002543	万和电气	3,700	71,484.00	0.07
572	002446	盛路通信	10,410	71,412.60	0.07
573	002148	北纬科技	12,300	71,340.00	0.07
574	002516	旷达科技	20,000	71,200.00	0.07
575	601116	三江购物	4,500	71,055.00	0.07
576	002540	亚太科技	13,600	70,720.00	0.07
577	300158	振东制药	13,800	70,656.00	0.07
578	002712	思美传媒	3,800	70,642.00	0.07
579	600995	文山电力	9,400	70,594.00	0.07
580	600800	天津磁卡	12,900	70,563.00	0.07
581	600624	复旦复华	13,700	70,555.00	0.07
582	000666	经纬纺机	3,900	70,512.00	0.07
583	300228	富瑞特装	12,300	70,479.00	0.07
584	600595	中孚实业	26,000	70,460.00	0.07
585	002521	齐峰新材	10,800	70,416.00	0.07
586	000657	中钨高新	6,900	70,311.00	0.07
587	600626	申达股份	13,600	70,040.00	0.07
588	600798	宁波海运	19,200	69,888.00	0.07
589	300016	北陆药业	6,100	69,845.00	0.07
590	300527	中国应急	6,935	69,766.10	0.07
591	603777	来伊份	3,780	69,665.40	0.07
592	600459	贵研铂业	6,420	69,336.00	0.07
593	300097	智云股份	3,900	69,108.00	0.07
594	603003	龙宇燃油	8,300	68,973.00	0.07
595	300048	合康新能	22,440	68,890.80	0.07
596	603979	金诚信	8,072	68,854.16	0.07
597	002638	勤上股份	20,800	68,640.00	0.07
598	600662	强生控股	17,200	68,628.00	0.07
599	002335	科华恒盛	3,800	68,590.00	0.07
600	002496	辉丰股份	25,100	68,523.00	0.07
601	300256	星星科技	16,350	68,506.50	0.07

602	000544	中原环保	10,300	68,495.00	0.07
603	002284	亚太股份	11,800	68,440.00	0.07
604	002322	理工环科	5,400	68,418.00	0.07
605	000782	美达股份	11,700	68,328.00	0.07
606	300221	银禧科技	6,900	68,310.00	0.07
607	300303	聚飞光电	24,900	68,226.00	0.07
608	000407	胜利股份	16,500	68,145.00	0.07
609	000927	一汽夏利	17,500	68,075.00	0.07
610	002538	司尔特	14,100	67,962.00	0.07
611	601566	九牧王	4,600	67,850.00	0.07
612	000550	江铃汽车	5,600	67,816.00	0.07
613	601126	四方股份	13,300	67,697.00	0.07
614	603603	博天环境	3,300	67,617.00	0.07
615	002685	华东重机	8,200	67,486.00	0.07
616	300245	天玑科技	6,600	67,320.00	0.07
617	300322	硕贝德	7,900	67,308.00	0.07
618	000821	京山轻机	7,300	67,233.00	0.07
619	002060	粤水电	22,900	67,097.00	0.07
620	603108	润达医疗	5,980	67,095.60	0.07
621	603636	南威软件	6,699	66,990.00	0.07
622	600855	航天长峰	5,700	66,918.00	0.07
623	300021	大禹节水	12,850	66,563.00	0.07
624	000631	顺发恒业	19,400	66,542.00	0.07
625	002766	索菱股份	5,600	66,528.00	0.07
626	002656	摩登大道	6,920	66,501.20	0.07
627	603707	健友股份	2,450	66,468.50	0.07
628	000065	北方国际	8,675	66,450.50	0.07
629	002298	中电兴发	9,400	66,364.00	0.07
630	000965	天保基建	15,000	66,300.00	0.07
631	601890	亚星锚链	15,300	66,249.00	0.07
632	002339	积成电子	9,000	66,150.00	0.07
633	600246	万通地产	16,500	65,835.00	0.07
634	002418	康盛股份	15,600	65,832.00	0.07
635	002502	骅威文化	11,300	65,766.00	0.07
636	603466	凤语筑	2,500	65,625.00	0.07
637	002218	拓日新能	21,400	65,484.00	0.07
638	600571	信雅达	8,500	65,365.00	0.07
639	002141	贤丰控股	15,600	65,364.00	0.07
640	002515	金字火腿	13,360	65,196.80	0.07
641	300005	探路者	16,800	65,184.00	0.07
642	002355	兴民智通	8,400	65,184.00	0.07
643	002393	力生制药	2,660	65,116.80	0.07

644	002235	安妮股份	9,600	64,992.00	0.06
645	300148	天舟文化	14,430	64,935.00	0.06
646	000837	秦川机床	13,100	64,845.00	0.06
647	002177	御银股份	17,200	64,844.00	0.06
648	002850	科达利	2,300	64,768.00	0.06
649	002458	益生股份	3,700	64,750.00	0.06
650	000545	金浦钛业	17,200	64,672.00	0.06
651	603959	百利科技	3,600	64,404.00	0.06
652	300194	福安药业	13,700	64,390.00	0.06
653	603609	禾丰牧业	6,800	64,192.00	0.06
654	600652	游久游戏	13,600	64,056.00	0.06
655	002033	丽江旅游	8,810	64,048.70	0.06
656	600616	金枫酒业	9,800	63,994.00	0.06
657	300191	潜能恒信	3,600	63,936.00	0.06
658	000022	深赤湾A	2,800	63,896.00	0.06
659	002636	金安国纪	7,900	63,753.00	0.06
660	002792	通宇通讯	2,600	63,726.00	0.06
661	002124	天邦股份	14,750	63,720.00	0.06
662	002321	华英农业	10,400	63,648.00	0.06
663	000018	神州长城	19,100	63,412.00	0.06
664	002196	方正电机	8,620	63,357.00	0.06
665	600082	海泰发展	13,800	63,342.00	0.06
666	002182	云海金属	10,400	63,336.00	0.06
667	002288	超华科技	14,900	63,325.00	0.06
668	000043	中航善达	8,900	63,101.00	0.06
669	300625	三雄极光	3,100	63,085.00	0.06
670	601366	利群股份	6,800	63,036.00	0.06
671	002301	齐心集团	6,000	63,000.00	0.06
672	603612	索通发展	2,200	62,920.00	0.06
673	002648	卫星石化	5,700	62,871.00	0.06
674	002619	艾格拉斯	14,980	62,766.20	0.06
675	002769	普路通	5,000	62,700.00	0.06
676	601500	通用股份	6,200	62,620.00	0.06
677	002705	新宝股份	6,400	62,528.00	0.06
678	002425	凯撒文化	13,160	62,510.00	0.06
679	600758	红阳能源	14,400	62,496.00	0.06
680	002314	南山控股	15,500	62,465.00	0.06
681	600207	安彩高科	9,400	62,322.00	0.06
682	300465	高伟达	7,400	62,308.00	0.06
683	600449	宁夏建材	7,900	62,252.00	0.06
684	002331	皖通科技	8,400	62,160.00	0.06
685	000506	中润资源	19,300	62,146.00	0.06

686	600130	波导股份	20,700	62,100.00	0.06
687	000815	美利云	7,600	62,092.00	0.06
688	300269	联建光电	9,500	62,035.00	0.06
689	600548	深高速	7,900	62,015.00	0.06
690	603839	安正时尚	3,420	61,936.20	0.06
691	000558	莱茵体育	17,300	61,934.00	0.06
692	300304	云意电气	14,700	61,740.00	0.06
693	300209	天泽信息	4,000	61,680.00	0.06
694	000070	特发信息	8,500	61,625.00	0.06
695	002518	科士达	6,170	61,514.90	0.06
696	002166	莱茵生物	8,400	61,488.00	0.06
697	300066	三川智慧	16,700	61,456.00	0.06
698	002545	东方铁塔	10,300	61,285.00	0.06
699	002476	宝莫股份	14,200	61,202.00	0.06
700	603299	井神股份	7,400	61,050.00	0.06
701	000665	湖北广电	7,000	61,040.00	0.06
702	600630	龙头股份	8,100	60,993.00	0.06
703	300679	电连技术	1,620	60,928.20	0.06
704	300034	钢研高纳	6,500	60,840.00	0.06
705	603843	正平股份	5,300	60,738.00	0.06
706	300520	科大国创	2,940	60,564.00	0.06
707	300359	全通教育	8,500	60,520.00	0.06
708	002406	远东传动	11,000	60,390.00	0.06
709	603298	杭叉集团	4,900	60,221.00	0.06
710	300685	艾德生物	1,080	60,220.80	0.06
711	600838	上海九百	8,600	60,200.00	0.06
712	000554	泰山石油	10,200	60,180.00	0.06
713	603359	东珠景观	2,780	60,103.60	0.06
714	603900	莱绅通灵	2,980	60,017.20	0.06
715	002782	可立克	3,800	59,964.00	0.06
716	300215	电科院	10,100	59,792.00	0.06
717	603618	杭电股份	9,700	59,752.00	0.06
718	600973	宝胜股份	16,360	59,714.00	0.06
719	300109	新开源	1,700	58,990.00	0.06
720	603118	共进股份	10,500	58,800.00	0.06
721	600467	好当家	25,200	58,464.00	0.06
722	002432	九安医疗	8,500	58,395.00	0.06
723	300737	科顺股份	4,900	58,359.00	0.06
724	002494	华斯股份	7,000	58,310.00	0.06
725	600533	栖霞建设	16,900	58,305.00	0.06
726	000905	厦门港务	7,400	58,238.00	0.06
727	601789	宁波建工	16,100	58,121.00	0.06

728	002584	西陇科学	7,800	58,032.00	0.06
729	002554	惠博普	18,400	57,960.00	0.06
730	600035	楚天高速	18,800	57,904.00	0.06
731	300114	中航电测	6,400	57,856.00	0.06
732	300497	富祥股份	1,500	57,660.00	0.06
733	300050	世纪鼎利	9,600	57,600.00	0.06
734	300363	博腾股份	5,700	57,570.00	0.06
735	600295	鄂尔多斯	6,400	57,536.00	0.06
736	300426	唐德影视	4,650	57,427.50	0.06
737	603595	东尼电子	800	57,200.00	0.06
738	000838	财信发展	15,500	57,195.00	0.06
739	300735	光弘科技	3,000	57,180.00	0.06
740	000151	中成股份	4,800	57,168.00	0.06
741	000404	长虹华意	13,125	56,831.25	0.06
742	300311	任子行	7,605	56,809.35	0.06
743	000971	高升控股	13,100	56,723.00	0.06
744	600012	皖通高速	9,500	56,620.00	0.06
745	002556	辉隆股份	11,300	56,500.00	0.06
746	002530	金财互联	6,200	56,482.00	0.06
747	300410	正业科技	2,400	56,424.00	0.06
748	002175	东方网络	14,800	56,388.00	0.06
749	600381	青海春天	6,800	56,372.00	0.06
750	002135	东南网架	11,100	56,277.00	0.06
751	603648	畅联股份	3,100	56,172.00	0.06
752	300302	同有科技	5,500	56,100.00	0.06
753	002059	云南旅游	7,700	56,056.00	0.06
754	000925	众合科技	9,020	55,924.00	0.06
755	600830	香溢融通	10,300	55,826.00	0.06
756	600313	农发种业	18,500	55,685.00	0.06
757	002234	民和股份	4,800	55,584.00	0.06
758	603357	设计总院	2,800	55,552.00	0.06
759	600650	锦江投资	5,300	55,544.00	0.06
760	002053	云南能投	5,500	55,440.00	0.06
761	300613	富瀚微	400	55,400.00	0.06
762	002329	皇氏集团	13,000	55,380.00	0.06
763	300332	天壕环境	11,900	55,335.00	0.06
764	300006	莱美药业	13,300	55,328.00	0.06
765	300386	飞天诚信	4,700	55,319.00	0.06
766	002772	众兴菌业	6,600	55,242.00	0.06
767	600818	中路股份	3,600	55,116.00	0.06
768	600283	钱江水利	5,059	54,940.74	0.05
769	300064	豫金刚石	10,200	54,774.00	0.05

770	603010	万盛股份	2,900	54,723.00	0.05
771	603801	志邦股份	1,200	54,576.00	0.05
772	002137	麦达数字	6,300	54,369.00	0.05
773	000532	华金资本	5,500	54,285.00	0.05
774	000701	厦门信达	7,800	54,132.00	0.05
775	002590	万安科技	6,600	54,120.00	0.05
776	000416	民生控股	11,400	54,036.00	0.05
777	601700	风范股份	15,600	53,976.00	0.05
778	002519	银河电子	12,080	53,635.20	0.05
779	300276	三丰智能	4,400	53,592.00	0.05
780	300255	常山药业	9,900	53,559.00	0.05
781	603626	科森科技	3,640	52,925.60	0.05
782	300307	慈星股份	8,600	52,718.00	0.05
783	002274	华昌化工	8,700	52,635.00	0.05
784	000517	荣安地产	17,200	52,632.00	0.05
785	603555	贵人鸟	5,000	52,600.00	0.05
786	002349	精华制药	9,000	52,560.00	0.05
787	601137	博威合金	6,500	52,520.00	0.05
788	002662	京威股份	12,500	52,500.00	0.05
789	600135	乐凯胶片	7,300	52,487.00	0.05
790	300011	鼎汉技术	8,200	52,316.00	0.05
791	000811	冰轮环境	11,000	52,250.00	0.05
792	300366	创意信息	5,800	52,084.00	0.05
793	603126	中材节能	8,200	52,070.00	0.05
794	002226	江南化工	9,600	52,032.00	0.05
795	300248	新开普	8,491	51,964.92	0.05
796	000819	岳阳兴长	5,455	51,877.05	0.05
797	300507	苏奥传感	2,200	51,876.00	0.05
798	600933	爱柯迪	4,500	51,840.00	0.05
799	600526	菲达环保	8,800	51,744.00	0.05
800	601595	上海电影	3,200	51,616.00	0.05
801	300205	天喻信息	6,800	51,612.00	0.05
802	000498	山东路桥	12,100	51,546.00	0.05
803	600501	航天晨光	6,900	51,543.00	0.05
804	300441	鲍斯股份	5,540	51,522.00	0.05
805	600744	华银电力	19,000	51,300.00	0.05
806	603919	金徽酒	3,100	51,243.00	0.05
807	300664	鹏鹞环保	2,700	51,165.00	0.05
808	002733	雄韬股份	5,000	51,150.00	0.05
809	600279	重庆港九	11,500	51,060.00	0.05
810	000923	河北宣工	3,600	51,012.00	0.05
811	002567	唐人神	11,250	50,962.50	0.05

812	600775	南京熊猫	9,000	50,940.00	0.05
813	002378	章源钨业	7,700	50,897.00	0.05
814	002524	光正集团	10,400	50,856.00	0.05
815	000885	同力水泥	5,000	50,800.00	0.05
816	002356	赫美集团	4,200	50,778.00	0.05
817	600876	洛阳玻璃	3,600	50,652.00	0.05
818	002246	北化股份	5,900	50,563.00	0.05
819	002906	华阳集团	2,700	50,490.00	0.05
820	000892	欢瑞世纪	10,700	50,397.00	0.05
821	002631	德尔未来	6,800	50,320.00	0.05
822	002158	汉钟精机	5,600	50,288.00	0.05
823	300502	新易盛	3,400	50,286.00	0.05
824	600354	敦煌种业	9,800	50,176.00	0.05
825	600173	卧龙地产	11,600	49,880.00	0.05
826	000011	深物业A	4,500	49,815.00	0.05
827	002451	摩恩电气	5,000	49,800.00	0.05
828	002918	蒙娜丽莎	2,100	49,686.00	0.05
829	002535	林州重机	13,200	49,632.00	0.05
830	000700	模塑科技	13,500	49,545.00	0.05
831	002457	青龙管业	6,200	49,476.00	0.05
832	002071	长城影视	9,000	49,320.00	0.05
833	300295	三六五网	3,700	49,284.00	0.05
834	300263	隆华节能	9,400	49,256.00	0.05
835	002658	雪迪龙	6,300	49,203.00	0.05
836	000561	烽火电子	8,300	49,136.00	0.05
837	601900	南方传媒	5,200	49,088.00	0.05
838	000533	万家乐	13,300	49,077.00	0.05
839	600814	杭州解百	7,900	48,980.00	0.05
840	300378	鼎捷软件	3,900	48,945.00	0.05
841	002539	云图控股	11,200	48,944.00	0.05
842	603997	继峰股份	4,500	48,915.00	0.05
843	603116	红蜻蜓	3,700	48,544.00	0.05
844	300213	佳讯飞鸿	7,700	48,510.00	0.05
845	600523	贵航股份	5,680	48,280.00	0.05
846	600107	美尔雅	7,800	48,204.00	0.05
847	000038	深大通	2,660	48,146.00	0.05
848	600475	华光股份	4,500	48,105.00	0.05
849	300299	富春股份	10,295	48,077.65	0.05
850	300052	中青宝	4,500	47,970.00	0.05
851	600592	龙溪股份	7,800	47,970.00	0.05
852	002101	广东鸿图	5,650	47,912.00	0.05
853	002746	仙坛股份	4,210	47,741.40	0.05

854	002781	奇信股份	3,000	47,400.00	0.05
855	300328	宜安科技	6,300	47,124.00	0.05
856	300381	溢多利	5,400	47,034.00	0.05
857	300051	三五互联	5,800	46,980.00	0.05
858	603980	吉华集团	2,900	46,980.00	0.05
859	002788	鹭燕医药	2,800	46,900.00	0.05
860	601949	中国出版	9,700	46,851.00	0.05
861	002852	道道全	3,040	46,724.80	0.05
862	600119	长江投资	5,700	46,626.00	0.05
863	002872	天圣制药	1,500	46,575.00	0.05
864	300262	巴安水务	8,950	46,361.00	0.05
865	600692	亚通股份	6,600	46,266.00	0.05
866	300172	中电环保	8,200	46,166.00	0.05
867	300531	优博讯	3,200	46,112.00	0.05
868	000058	深赛格	8,900	45,568.00	0.05
869	603882	金域医学	1,700	45,560.00	0.05
870	300362	天翔环境	4,700	45,496.00	0.05
871	002651	利君股份	8,800	45,320.00	0.05
872	000791	甘肃电投	10,300	45,320.00	0.05
873	002232	启明信息	5,800	45,298.00	0.05
874	000607	华媒控股	11,000	45,210.00	0.05
875	600734	实达集团	6,600	45,210.00	0.05
876	002579	中京电子	5,100	45,135.00	0.05
877	002742	三圣股份	4,600	45,126.00	0.05
878	300528	幸福蓝海	3,980	44,775.00	0.04
879	300468	四方精创	2,341	44,759.92	0.04
880	300074	华平股份	11,600	44,660.00	0.04
881	601015	陕西黑猫	6,400	44,608.00	0.04
882	300518	盛讯达	900	44,559.00	0.04
883	601858	中国科传	4,700	44,509.00	0.04
884	600190	锦州港	14,200	44,446.00	0.04
885	603227	雪峰科技	11,400	44,232.00	0.04
886	000514	渝开发	9,800	44,198.00	0.04
887	002726	龙大肉食	6,270	44,140.80	0.04
888	300494	盛天网络	3,500	44,100.00	0.04
889	002346	柘中股份	3,400	43,996.00	0.04
890	603258	电魂网络	2,200	43,890.00	0.04
891	002461	珠江啤酒	8,400	43,848.00	0.04
892	600310	桂东电力	11,100	43,845.00	0.04
893	600386	北巴传媒	11,200	43,568.00	0.04
894	002577	雷柏科技	3,200	43,456.00	0.04
895	600113	浙江东日	5,300	43,407.00	0.04

896	300171	东富龙	6,400	43,264.00	0.04
897	603920	世运电路	3,300	43,197.00	0.04
898	002499	科林环保	3,900	43,095.00	0.04
899	002351	漫步者	6,600	42,834.00	0.04
900	603313	恒康家居	2,200	42,790.00	0.04
901	002616	长青集团	8,000	42,640.00	0.04
902	000920	南方汇通	6,900	42,573.00	0.04
903	300173	智慧松德	6,300	42,399.00	0.04
904	002574	明牌珠宝	7,600	42,104.00	0.04
905	300447	全信股份	3,230	41,796.20	0.04
906	600629	华建集团	3,500	41,755.00	0.04
907	002114	罗平锌电	5,100	41,310.00	0.04
908	300350	华鹏飞	5,080	41,300.40	0.04
909	002401	中远海科	4,100	41,123.00	0.04
910	600278	东方创业	5,200	41,028.00	0.04
911	300533	冰川网络	1,100	40,909.00	0.04
912	002783	凯龙股份	4,940	40,656.20	0.04
913	002534	杭锅股份	6,000	40,620.00	0.04
914	300512	中亚股份	2,400	40,584.00	0.04
915	300440	运达科技	6,200	40,486.00	0.04
916	002575	群兴玩具	10,100	40,097.00	0.04
917	002901	大博医疗	1,100	39,952.00	0.04
918	603103	横店影视	1,300	39,936.00	0.04
919	603058	永吉股份	3,500	39,830.00	0.04
920	603779	威龙股份	2,700	39,663.00	0.04
921	300419	浩丰科技	6,100	39,467.00	0.04
922	603800	道森股份	2,500	39,350.00	0.04
923	002606	大连电瓷	8,000	39,200.00	0.04
924	300511	雪榕生物	4,405	39,116.40	0.04
925	600828	茂业商业	7,608	38,800.80	0.04
926	603999	读者传媒	6,500	38,740.00	0.04
927	603817	海峡环保	4,800	38,592.00	0.04
928	300432	富临精工	4,400	38,544.00	0.04
929	300140	中环装备	4,600	38,502.00	0.04
930	603458	勘设股份	900	38,421.00	0.04
931	002759	天际股份	4,000	38,400.00	0.04
932	300660	江苏雷利	1,460	38,091.40	0.04
933	603303	得邦照明	3,700	38,036.00	0.04
934	603727	博迈科	2,500	37,925.00	0.04
935	603385	惠达卫浴	3,360	37,665.60	0.04
936	300633	开立医疗	1,100	37,466.00	0.04
937	300443	金雷风电	3,500	36,645.00	0.04

938	300368	汇金股份	6,100	36,600.00	0.04
939	603113	金能科技	2,600	36,582.00	0.04
940	603358	华达科技	1,840	36,579.20	0.04
941	300160	秀强股份	8,700	36,540.00	0.04
942	300063	天龙集团	10,500	36,330.00	0.04
943	300100	双林股份	3,300	36,135.00	0.04
944	300471	厚普股份	5,150	36,101.50	0.04
945	603305	旭升股份	1,200	35,916.00	0.04
946	300312	邦讯技术	4,500	35,910.00	0.04
947	000626	远大控股	5,100	35,904.00	0.04
948	300516	久之洋	1,000	35,730.00	0.04
949	603619	中曼石油	1,100	35,717.00	0.04
950	603533	掌阅科技	1,100	35,596.00	0.04
951	300356	光一科技	5,850	35,392.50	0.04
952	300484	蓝海华腾	2,400	35,352.00	0.04
953	002605	姚记扑克	4,800	35,280.00	0.04
954	603730	岱美股份	1,300	35,022.00	0.04
955	603098	森特股份	2,860	34,949.20	0.03
956	002231	奥维通信	6,000	34,920.00	0.03
957	601882	海天精工	3,000	34,680.00	0.03
958	002287	奇正藏药	1,200	34,548.00	0.03
959	601038	一拖股份	6,500	34,385.00	0.03
960	601968	宝钢包装	8,900	34,354.00	0.03
961	002791	坚朗五金	2,800	34,132.00	0.03
962	603508	思维列控	1,000	33,970.00	0.03
963	002822	中装建设	5,900	33,925.00	0.03
964	603166	福达股份	5,200	33,644.00	0.03
965	002911	佛燃股份	1,500	33,495.00	0.03
966	600735	新华锦	5,000	33,450.00	0.03
967	603996	中新科技	3,400	33,014.00	0.03
968	002388	新亚制程	5,700	32,718.00	0.03
969	001896	豫能控股	9,200	32,568.00	0.03
970	002323	*ST百特	6,300	32,004.00	0.03
971	002724	海洋王	5,680	31,751.20	0.03
972	603339	四方冷链	1,600	31,744.00	0.03
973	300726	宏达电子	1,100	31,240.00	0.03
974	000722	湖南发展	5,100	31,008.00	0.03
975	002907	华森制药	1,100	30,877.00	0.03
976	002703	浙江世宝	6,200	30,690.00	0.03
977	603861	白云电器	2,600	30,238.00	0.03
978	603043	广州酒家	1,300	29,601.00	0.03
979	002762	金发拉比	4,125	29,452.50	0.03

980	603277	银都股份	2,400	29,424.00	0.03
981	603165	荣晟环保	1,260	29,206.80	0.03
982	603600	永艺股份	3,000	28,320.00	0.03
983	603398	邦宝益智	1,600	27,536.00	0.03
984	603218	日月股份	1,400	26,222.00	0.03
985	603848	好太太	1,100	26,059.00	0.03
986	603958	哈森股份	2,600	26,000.00	0.03
987	603055	台华新材	1,700	25,075.00	0.03
988	603711	香飘飘	1,100	24,255.00	0.02
989	300682	朗新科技	1,100	24,189.00	0.02
990	002786	银宝山新	3,900	24,180.00	0.02
991	002801	微光股份	800	21,168.00	0.02
992	002895	川恒股份	1,000	21,100.00	0.02
993	300508	维宏股份	640	20,646.40	0.02
994	603421	鼎信通讯	1,100	19,822.00	0.02
995	603803	瑞斯康达	1,400	18,130.00	0.02
996	603081	大丰实业	1,200	17,964.00	0.02
997	603557	起步股份	1,300	17,407.00	0.02
998	603063	禾望电气	1,500	16,965.00	0.02
999	603758	秦安机电	1,100	9,790.00	0.01

### 7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000048	*ST康达	7,600	166,440.00	0.17
2	600399	抚顺特钢	20,900	114,950.00	0.11
3	002263	*ST东南	35,100	103,896.00	0.10
4	300747	锐科激光	1,286	103,342.96	0.10
5	600784	鲁银投资	10,000	54,600.00	0.05
6	000409	*ST地矿	9,547	31,218.69	0.03
7	002260	*ST德奥	5,200	24,648.00	0.02

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300601	康泰生物	346,234.00	0.34
2	300176	鸿特科技	344,395.00	0.34

3	300142	沃森生物	339,242.00	0.34
4	002507	涪陵榨菜	287,396.00	0.28
5	601699	潞安环能	286,305.00	0.28
6	002821	凯莱英	250,094.00	0.25
7	300558	贝达药业	230,696.00	0.23
8	000697	炼石有色	215,354.00	0.21
9	300347	泰格医药	208,954.00	0.21
10	002727	一心堂	207,786.00	0.21
11	002035	华帝股份	185,645.00	0.18
12	000799	酒鬼酒	175,180.00	0.17
13	000710	贝瑞基因	171,847.00	0.17
14	000507	珠海港	169,577.00	0.17
15	300168	万达信息	167,964.00	0.17
16	000735	罗牛山	167,616.00	0.17
17	603399	新华龙	161,017.00	0.16
18	600200	江苏吴中	160,068.00	0.16
19	002292	奥飞娱乐	159,773.00	0.16
20	300355	蒙草生态	155,357.00	0.15

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300418	昆仑万维	336,090.00	0.33
2	002600	领益智造	318,372.00	0.32
3	300308	中际旭创	277,603.00	0.27
4	603885	吉祥航空	242,015.00	0.24
5	002925	盈趣科技	220,131.02	0.22
6	000735	罗牛山	211,241.00	0.21
7	002920	德赛西威	197,866.95	0.20
8	000518	四环生物	183,838.00	0.18
9	300454	深信服	183,812.04	0.18
10	002509	天广中茂	180,441.00	0.18
11	000980	众泰汽车	179,972.00	0.18
12	002625	光启技术	178,508.30	0.18
13	002302	西部建设	174,789.00	0.17
14	002916	深南电路	169,842.88	0.17
15	002926	华西证券	164,072.12	0.16
16	002647	仁东控股	155,078.75	0.15

17	000553	沙隆达A	153,290.00	0.15
18	300142	沃森生物	146,929.00	0.15
19	300741	华宝股份	146,899.35	0.15
20	300347	泰格医药	145,469.00	0.14

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	47,354,192.19
卖出股票收入(成交)总额	32,799,400.13

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中:政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债(可交换债)	2,679.22	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,679.22	0.00

#### 7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128023	亚太转债	9	783.45	0.00
2	128019	久立转2	6	551.10	0.00
3	128037	岩土转债	5	433.25	0.00
4	128018	时达转债	4	347.08	0.00
5	123007	道氏转债	3	305.40	0.00

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1812	IC1812	2	2,003,360.00	-178,640.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-178,640.00
股指期货投资本期收益(元)					-152,520.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-216,880.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情況下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	412,870.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	729.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	413,600.59

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128018	时达转债	347.08	0.00
2	128019	久立转2	551.10	0.00
3	128023	亚太转债	783.45	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允	占基金资产净值	流通受限情况
			价值(人民币元)		
1	000048	*ST康达	166,440.00	0.17	重大事项
2	600399	抚顺特钢	114,950.00	0.11	重大事项
3	002263	*ST东南	103,896.00	0.10	重大事项
4	600784	鲁银投资	54,600.00	0.05	重大事项

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		—	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,339	44,891.28	3,317,400.00	2.21	146,574,600.00	97.79	-	-

注:户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	颜飞	6,246,100.00	4.17
2	张改花	4,000,000.00	2.67
3	李洪琴	3,780,000.00	2.52
4	方正证券股份有限公司	3,047,100.00	2.03
5	王思宇	2,500,000.00	1.67
6	杨海锋	2,100,000.00	1.40
7	张永劭	2,006,000.00	1.34
8	陶冶	2,000,000.00	1.33
9	张瑞华	1,861,300.00	1.24
10	王磊	1,600,000.00	1.07

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	122,892,000.00
本报告期基金总申购份额	63,000,000.00
减: 本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	149,892,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
万联证券	1	50,870,24 1.16	64.06%	5,087.65	64.12%	-
华泰证券	4	26,952,48 3.09	33.94%	2,690.09	33.90%	-
国信证券	1	1,587,550 .53	2.00%	157.43	1.98%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金管理交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	37,139.20	29.15%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	90,255.14	70.85%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注:-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金增加国泰君安为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 02 月 08 日
2	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)(2018 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 05 月 04 日
3	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2018 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 05 月 04 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金合同。
- 3、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

### 12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>