

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十七日

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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	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
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
8 基金份额持有人信息	63

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 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的情况	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
9 开放式基金份额变动	65
10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	70
11 影响投资者决策的其他重要信息	70
12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金	
基金简称	广发中证 1000 指数	
基金主代码	006486	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	32,795,990.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
下属分级基金的交易代码	006486	006487
报告期末下属分级基金的份额总额	23,202,484.08 份	9,593,505.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，有效跟踪中证 1000 指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的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将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。 对无法严格按照标的指数进行复制的情况，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，优化确定投资组合中的个股权重，以获得更接近标的指数的收益率。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与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，主要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	广发基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105828		95588
传真	020-89899158		010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）		北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼		北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308		100140
法定代表人	孙树明		陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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（2020年1月1日至2020年6月30日）	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
本期已实现收益	2,383,302.54	1,037,952.38
本期利润	4,227,220.66	1,949,760.25
加权平均基金份额本期利润	0.1785	0.1762

本期加权平均净值利润率	14.36%	14.21%
本期基金份额净值增长率	14.90%	14.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
期末可供分配利润	2,504,393.12	1,008,605.29
期末可供分配基金份额利润	0.1079	0.1051
期末基金资产净值	31,344,496.05	12,932,313.83
期末基金份额净值	1.3509	1.3480
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
基金份额累计净值增长率	35.09%	34.80%

注：（1）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。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

广发中证 1000 指数 A

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	8.43%	0.84%	8.21%	0.85%	0.22%	-0.01%
过去三个月	16.88%	1.16%	15.59%	1.17%	1.29%	-0.01%
过去六个月	14.90%	1.75%	12.92%	1.79%	1.98%	-0.04%
过去一年	20.58%	1.45%	17.93%	1.48%	2.65%	-0.03%
自基金合同生效起至今	35.09%	1.49%	40.60%	1.57%	-5.51%	-0.08%

广发中证 1000 指数 C

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	8.39%	0.84%	8.21%	0.85%	0.18%	-0.01%
过去三个月	16.77%	1.16%	15.59%	1.17%	1.18%	-0.01%
过去六个月	14.67%	1.75%	12.92%	1.79%	1.75%	-0.04%
过去一年	20.19%	1.45%	17.93%	1.48%	2.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	34.80%	1.49%	40.60%	1.57%	-5.80%	-0.08%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处

于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

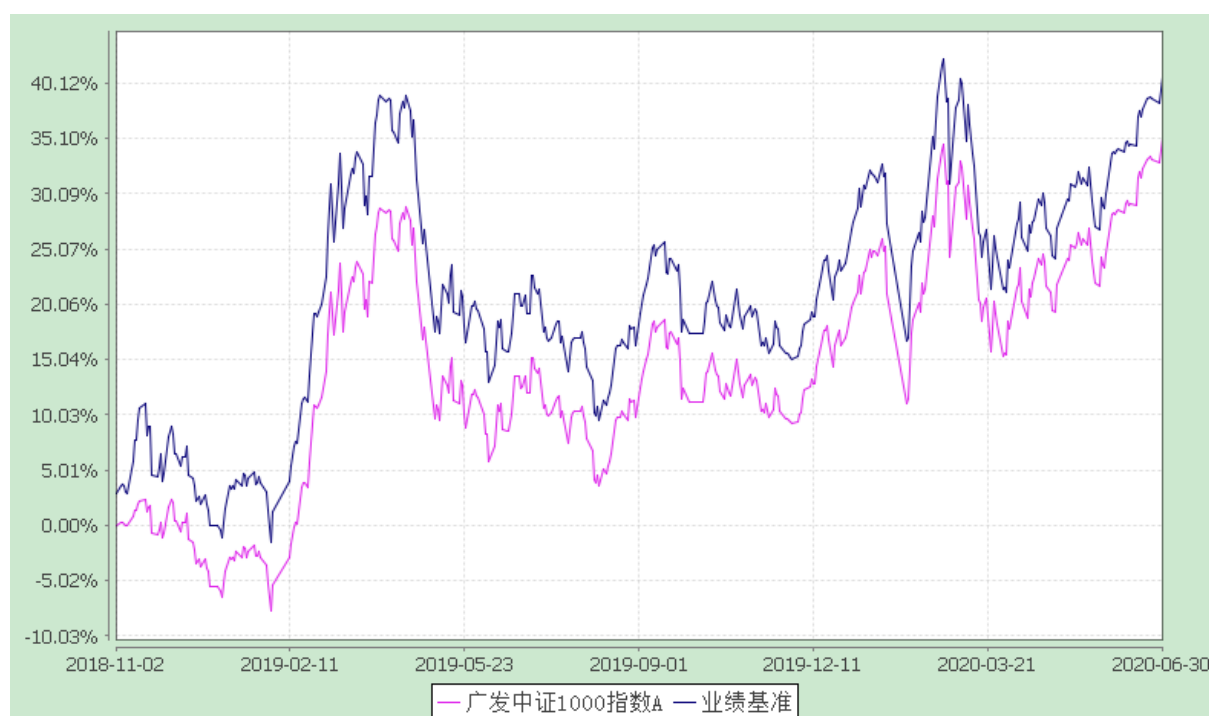
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

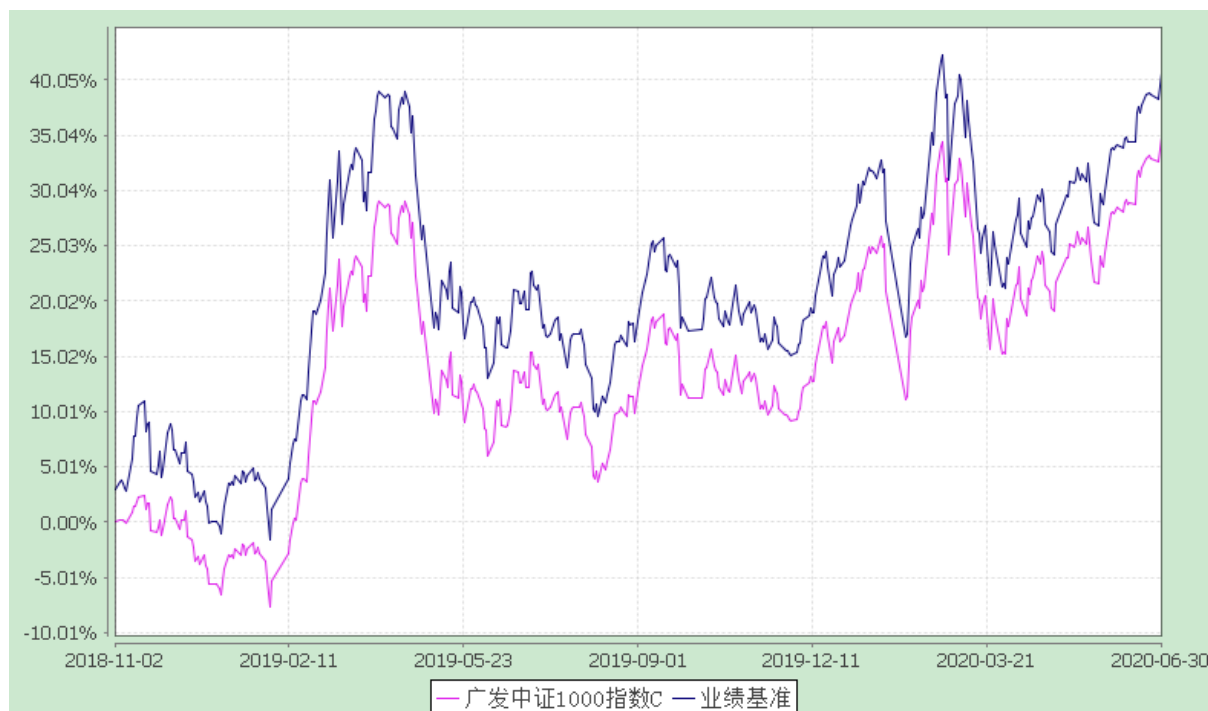
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 11 月 2 日至 2020 年 6 月 30 日)

广发中证 1000 指数 A



广发中证 1000 指数 C



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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力

资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理 225 只开放式基金，管理公募基金规模为 6394.81 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

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		
罗国庆	本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；广发中证医疗指数分级证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 100 交	2018-11-02	-	11 年	罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理 (自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)。

	易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部副总经理				
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券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合规守信情况的说明

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关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

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合

平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 3 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本基金跟踪的标的是中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

2020 年上半年，A 股市场整体震荡上行，结构分化明显。沪深 300 指数上涨 1.64%，中证 500 指数上涨 11.33%，创业板指数上涨 35.60%，中证 1000 指数上涨 13.52%。市场整体上涨原因有以下三点：（1）在疫情影响下，中国经济比其他海外经济体更有韧性，中国经济复苏更为明确，中国的股票资产性价比更高。（2）国内货币财政政策对经济的托底作用显现。今年上半年以来，随着统筹推进疫情防控和经济社会发展的成效继续显现，复工、复产、复商、复市全面推进，国内生产需求继续改善，就业和物价总体平稳，经济继续呈现恢复态势。（3）银行理财收益率不断下行，债券基金以及货币基金收益率持续下降，居民大类资产配置的需求也发生变化，权益资产吸引力增加。

在基金投资运作方面，报告期内本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，运作过程中未发生任何风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 14.90%，C 类基金份额净值增长率为 14.67%，同期业绩比较基准收益率为 12.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为 A 股将延续 2 季度的反弹趋势，理由如下：首先，在疫情中开启的全球货币宽松政策短期难以改变，海外资金可能进一步向性价比高的新兴市场流入，加之资本市场改革创新加速，A 股股票资产更受海外资金青睐。此外，中美关系波动也是近年来对市场冲击较大的黑天鹅事件之一。虽然美国仍然继续打击中国高科技企业，但和过去两年不同的是，今年并未出现全面的贸易战。考虑到美国自身经济处于修复期，预计中美的碰撞更可能聚焦在局部摩擦，而非全面冲突。最后，银行理财的收益率下降叠加资管新规打破刚兑的影响，股票型基金发行规模大增，居民加大了股票资产的配置比例，预计今年下半年我国的货币流动性依然保持宽松，并且居民大类资产配置结构向权益市场转化是长期渐进的过程，这些有利因素将成为助力 A 股市场向上的动能。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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

本报告期内，本基金托管人在对广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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：广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,675,594.25	2,489,480.16
结算备付金		36,787.51	17,667.25
存出保证金		11,086.83	2,934.80

交易性金融资产	6.4.7.2	42,049,129.67	40,290,079.51
其中：股票投资		42,049,129.67	40,290,079.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		420,874.79	-
应收利息	6.4.7.5	282.31	629.38
应收股利		-	-
应收申购款		153,161.82	557,837.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		45,346,917.18	43,358,628.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
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		-	6,733.08
应付赎回款		946,860.54	388,647.05
应付管理人报酬		18,455.50	18,505.40
应付托管费		3,691.08	3,701.07
应付销售服务费		4,638.83	5,242.92
应付交易费用	6.4.7.7	41,005.83	35,634.67
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	55,455.52	27,545.15
负债合计		1,070,107.30	486,009.34
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	32,795,990.03	36,468,894.84
未分配利润	6.4.7.10	11,480,819.85	6,403,724.27
所有者权益合计		44,276,809.88	42,872,619.11
负债和所有者权益总计		45,346,917.18	43,358,628.45

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，广发中证 1000 指数 A 基金份额净值人民币 1.3509 元，基金份额总额 23,202,484.08 份；广发中证 1000 指数 C 基金份额净值人民币 1.3480 元，基金份额总额 9,593,505.95 份；总份额总额 32,795,990.03 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		6,508,626.62	2,300,044.70
1.利息收入		10,481.51	12,335.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,481.51	12,335.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,704,383.78	837,377.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,432,852.22	502,701.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	271,531.56	334,676.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,755,725.99	1,378,978.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	38,035.34	71,353.20
减：二、费用		331,645.71	249,058.40
1. 管理人报酬		107,020.54	91,692.57
2. 托管费		21,404.11	18,338.51
3. 销售服务费		27,176.86	28,636.53
4. 交易费用	6.4.7.18	121,358.26	80,266.34
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	6.4.7.19	54,685.94	30,124.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,176,980.91	2,050,986.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,176,980.91	2,050,986.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	36,468,894.84	6,403,724.27	42,872,619.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,176,980.91	6,176,980.91
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）	-3,672,904.81	-1,099,885.33	-4,772,790.14
其中：1.基金申购款	40,761,636.13	9,541,418.57	50,303,054.70
2.基金赎回款	-44,434,540.94	-10,641,303.90	-55,075,844.84
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）	32,795,990.03	11,480,819.85	44,276,809.88
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	20,012,395.51	-1,107,325.17	18,905,070.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,050,986.30	2,050,986.30
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）	21,494,026.50	4,071,604.97	25,565,631.47
其中：1.基金申购款	68,381,020.72	10,353,910.91	78,734,931.63
2.基金赎回款	-46,886,994.22	-6,282,305.94	-53,169,300.16
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）	41,506,422.01	5,015,266.10	46,521,688.11

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：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2018]798 号《关于准予广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2018 年 9 月 25 日向社会公开发行募集并于 2018 年 11 月 2 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 9 月 25 日至 2018 年 10 月 26 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 19,676,167.43 元，有效认购户数为 971 户。其中广发中证 1000 指数 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 14,264,655.44 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 1,223.57 元；广发中证 1000 指数 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 5,409,779.19 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 509.23 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2020 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资

管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	2,675,594.25
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 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,675,594.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	36,637,129.80	42,049,129.67	5,411,999.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	36,637,129.80	42,049,129.67	5,411,999.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	262.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	4.50
应收结算备付金利息	14.85
应收债券利息	-
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	-

应收出借证券利息	-
其他	-
合计	282.31

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	41,005.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,005.83

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,891.08
应付证券出借违约金	-
预提费用	33,564.44
应付指数使用费	20,000.00
合计	55,455.52

6.4.7.9 实收基金

广发中证 1000 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,770,465.21	23,770,465.21
本期申购	14,395,687.49	14,395,687.49
本期赎回（以“-”号填列）	-14,963,668.62	-14,963,668.62
本期末	23,202,484.08	23,202,484.08

广发中证 1000 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,698,429.63	12,698,429.63
本期申购	26,365,948.64	26,365,948.64
本期赎回（以“-”号填列）	-29,470,872.32	-29,470,872.32
本期末	9,593,505.95	9,593,505.95

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

广发中证 1000 指数 A

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	148,649.60	4,026,841.40	4,175,491.00
本期利润	2,383,302.54	1,843,918.12	4,227,220.66
本期基金份额交易产生的变动数	-27,559.02	-233,140.67	-260,699.69
其中：基金申购款	667,372.97	2,774,124.13	3,441,497.10
基金赎回款	-694,931.99	-3,007,264.80	-3,702,196.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,504,393.12	5,637,618.85	8,142,011.97

广发中证 1000 指数 C

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	76,644.87	2,151,588.40	2,228,233.27
本期利润	1,037,952.38	911,807.87	1,949,760.25
本期基金份额交易产生的变动数	-105,991.96	-733,193.68	-839,185.64
其中：基金申购款	1,216,915.31	4,883,006.16	6,099,921.47
基金赎回款	-1,322,907.27	-5,616,199.84	-6,939,107.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,008,605.29	2,330,202.59	3,338,807.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,856.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	65.56
结算备付金利息收入	559.63

其他	-
合计	10,481.51

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	41,406,332.73
减：卖出股票成本总额	37,973,480.51
买卖股票差价收入	3,432,852.22

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	271,531.56
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	271,531.56

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	2,755,725.99
——股票投资	2,755,725.99
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	2,755,725.99

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	31,282.73
基金转换费收入	6,752.61
合计	38,035.34

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	121,358.26
银行间市场交易费用	-
合计	121,358.26

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	8,701.42
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,121.50
指数使用费	20,000.00
合计	54,685.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金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。

6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构

广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
------------	----------------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	17,828,789.01	22.75%	60,893,582.31	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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
广发证券股份有限公司	16,604.25	22.75%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
广发证券股份有限公司	56,681.86	100.00%	20,209.39	100.00%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	107,020.54	91,692.57
其中：支付销售机构的客户维护费	38,607.60	32,556.37

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	21,404.11	18,338.51

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C	合计
广发基金管理有限公司	-	2,811.82	2,811.82

司			
广发证券股份有限公司	-	2,777.79	2,777.79
中国工商银行股份有限公司	-	2,219.27	2,219.27
合计	-	7,808.88	7,808.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C	合计
广发基金管理有限公司	-	5,515.77	5,515.77
广发证券股份有限公司	-	2,642.97	2,642.97
中国工商银行股份有限公司	-	1,623.92	1,623.92
合计	-	9,782.66	9,782.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C
报告期初持有的基金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.10%	-	40.09%	-

6.4.10.5.2 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

广发中证 1000 指数 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发中证 1000 指数 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国工商银行股份有限公司	2,675,594.25	9,856.32	3,032,235.21	11,607.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	600459	贵研铂业	配股	450.00	4,671.00

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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
002638	*ST 勤上	2020-06-30	重大事项停牌	2.10	2020-07-01	2.00	6,700.00	22,163.08	14,070.00	-
000662	*ST 天夏	2020-06-30	重大事项停牌	2.48	2020-07-01	2.36	5,700.00	22,236.55	14,136.00	-
600242	*ST 中昌	2020-06-30	重大事项停牌	6.35	2020-07-01	6.03	2,600.00	21,827.22	16,510.00	-
600090	*ST 济堂	2020-06-30	重大事项停牌	2.90	2020-07-01	2.76	7,700.00	30,071.45	22,330.00	-
000597	东北制药	2020-06-24	重大事项停牌	5.22	2020-07-01	5.37	5,905.00	31,037.77	30,824.10	-
600226	*ST 瀚叶	2020-04-30	重大事项停牌	2.35	2020-07-01	2.23	18,000.00	62,445.48	42,300.00	-
002254	泰和新材	2020-06-29	重大事项停牌	13.60	2020-07-14	14.96	3,900.00	42,373.80	53,040.00	-
600185	格力地产	2020-06-30	重大事项停牌	11.61	2020-07-01	12.77	11,000.00	52,206.02	127,710.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	2,675,594.25	-	-	-	2,675,594.25

结算备付金	36,787.51	-	-	-	36,787.51
存出保证金	11,086.83	-	-	-	11,086.83
交易性金融资产	-	-	-	42,049,129.67	42,049,129.67
应收证券清算款	-	-	-	420,874.79	420,874.79
应收利息	-	-	-	282.31	282.31
应收申购款	-	-	-	153,161.82	153,161.82
资产总计	2,723,468.59	-	-	42,623,448.59	45,346,917.18
负债：					
应付赎回款	-	-	-	946,860.54	946,860.54
应付管理人报酬	-	-	-	18,455.50	18,455.50
应付托管费	-	-	-	3,691.08	3,691.08
应付销售服务费	-	-	-	4,638.83	4,638.83
应付交易费用	-	-	-	41,005.83	41,005.83
其他负债	-	-	-	55,455.52	55,455.52
负债总计	-	-	-	1,070,107.30	1,070,107.30
利率敏感度缺口	2,723,468.59	-	-	41,553,341.29	44,276,809.88
上年度末					
2019 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	2,489,480.16	-	-	-	2,489,480.16
结算备付金	17,667.25	-	-	-	17,667.25
存出保证金	2,934.80	-	-	-	2,934.80
交易性金融资产	-	-	-	40,290,079.51	40,290,079.51
应收利息	-	-	-	629.38	629.38
应收申购款	-	-	-	557,837.35	557,837.35
资产总计	2,510,082.21	-	-	40,848,546.24	43,358,628.45
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	6,733.08	6,733.08
应付赎回款	-	-	-	388,647.05	388,647.05
应付管理人报酬	-	-	-	18,505.40	18,505.40
应付托管费	-	-	-	3,701.07	3,701.07
应付销售服务费	-	-	-	5,242.92	5,242.92
应付交易费用	-	-	-	35,634.67	35,634.67
其他负债	-	-	-	27,545.15	27,545.15
负债总计	-	-	-	486,009.34	486,009.34

利率敏感度缺口	2,510,082.21	-	-	40,362,536.90	42,872,619.11
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	42,049,129.67	94.97	40,290,079.51	93.98
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	42,049,129.67	94.97	40,290,079.51	93.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	2,578,153.77	2,514,971.18
	业绩比较基准下降 5%	-2,578,153.77	-2,514,971.18

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 41,728,209.57 元，属于第二层次的余额为人民币 320,920.10 元，无属于第三层次的金额（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 39,310,525.05 元，属于第二层次的余额为人民币 979,554.46 元，无属于第三层次的金额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	42,049,129.67	92.73
	其中：股票	42,049,129.67	92.73
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	-	-
	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	2,712,381.76	5.98
8	其他各项资产	585,405.75	1.29
9	合计	45,346,917.18	100.00

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	381,476.50	0.86
B	采矿业	788,525.00	1.78
C	制造业	26,475,520.29	59.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	870,852.20	1.97
E	建筑业	950,418.20	2.15
F	批发和零售业	1,512,279.00	3.42
G	交通运输、仓储和邮政业	816,976.70	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,699,289.38	12.87

J	金融业	482,432.60	1.09
K	房地产业	1,315,991.60	2.97
L	租赁和商务服务业	489,334.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	796,231.40	1.80
N	水利、环境和公共设施管理业	729,918.00	1.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,542.80	0.04
Q	卫生和社会工作	123,877.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	420,372.00	0.95
S	综合	177,093.00	0.40
	合计	42,049,129.67	94.97

7.2.2 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通过港股通投资的股票。

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	300661	圣邦股份	830	253,191.50	0.57
2	300676	华大基因	1,400	218,274.00	0.49
3	002065	东华软件	16,800	210,336.00	0.48
4	300463	迈克生物	3,500	203,805.00	0.46
5	300326	凯利泰	6,500	189,150.00	0.43
6	000799	酒鬼酒	2,000	153,020.00	0.35
7	300724	捷佳伟创	1,700	150,501.00	0.34
8	300699	光威复材	2,280	143,024.40	0.32
9	002436	兴森科技	10,700	137,281.00	0.31
10	603005	晶方科技	1,700	133,722.00	0.30
11	002402	和而泰	8,200	132,922.00	0.30
12	002683	宏大爆破	3,800	132,620.00	0.30
13	300502	新易盛	2,100	132,552.00	0.30
14	002400	省广集团	12,500	131,125.00	0.30
15	300451	创业慧康	7,025	129,892.25	0.29
16	603345	安井食品	1,100	129,800.00	0.29

17	600984	建设机械	5,200	128,960.00	0.29
18	600185	格力地产	11,000	127,710.00	0.29
19	000540	中天金融	37,800	121,716.00	0.27
20	300037	新宙邦	2,200	121,132.00	0.27
21	300223	北京君正	1,200	121,128.00	0.27
22	002123	梦网集团	5,900	116,820.00	0.26
23	002481	双塔食品	6,700	116,044.00	0.26
24	300598	诚迈科技	600	113,640.00	0.26
25	000710	贝瑞基因	1,900	113,506.00	0.26
26	002791	坚朗五金	1,200	112,908.00	0.26
27	300346	南大光电	2,600	112,112.00	0.25
28	300457	赢合科技	3,500	111,580.00	0.25
29	002332	仙琚制药	6,600	111,144.00	0.25
30	002409	雅克科技	2,100	109,557.00	0.25
31	603520	司太立	1,300	109,278.00	0.25
32	002100	天康生物	6,700	107,870.00	0.24
33	300379	东方通	2,500	107,575.00	0.24
34	600988	赤峰黄金	9,000	107,100.00	0.24
35	300226	上海钢联	1,360	106,896.00	0.24
36	603708	家家悦	2,150	105,909.00	0.24
37	002705	新宝股份	2,900	105,792.00	0.24
38	600882	妙可蓝多	2,900	105,241.00	0.24
39	002675	东诚药业	5,000	104,750.00	0.24
40	002568	百润股份	2,300	104,236.00	0.24
41	600641	万业企业	4,400	103,400.00	0.23
42	300054	鼎龙股份	6,200	102,920.00	0.23
43	300073	当升科技	3,100	102,517.00	0.23
44	300476	胜宏科技	4,200	101,010.00	0.23
45	300036	超图软件	4,000	100,720.00	0.23
46	300369	绿盟科技	4,300	100,147.00	0.23
47	600305	恒顺醋业	5,388	99,947.40	0.23
48	300725	药石科技	790	98,157.50	0.22
49	603456	九洲药业	3,600	97,560.00	0.22
50	603881	数据港	900	97,263.00	0.22
51	002727	一心堂	2,600	96,486.00	0.22
52	000818	航锦科技	4,300	96,019.00	0.22
53	603027	千禾味业	3,020	95,371.60	0.22
54	300674	宇信科技	2,200	94,930.00	0.21
55	600812	华北制药	7,300	94,097.00	0.21
56	300236	上海新阳	1,550	93,093.00	0.21
57	002214	大立科技	3,300	92,994.00	0.21
58	300747	锐科激光	850	92,505.50	0.21
59	300685	艾德生物	1,200	92,352.00	0.21
60	600720	祁连山	5,600	91,000.00	0.21

61	603686	龙马环卫	3,720	90,656.40	0.20
62	603737	三棵树	980	90,375.60	0.20
63	600323	瀚蓝环境	4,100	89,708.00	0.20
64	002425	凯撒文化	5,100	89,556.00	0.20
65	000403	双林生物	1,200	88,956.00	0.20
66	300567	精测电子	1,300	88,725.00	0.20
67	002647	仁东控股	2,500	88,700.00	0.20
68	600873	梅花生物	19,500	88,530.00	0.20
69	000672	上峰水泥	3,700	87,357.00	0.20
70	002126	银轮股份	7,100	86,904.00	0.20
71	002467	二六三	12,280	86,328.40	0.19
72	300294	博雅生物	2,300	86,227.00	0.19
73	002216	三全食品	3,600	86,040.00	0.19
74	300348	长亮科技	4,525	85,975.00	0.19
75	601636	旗滨集团	14,500	85,840.00	0.19
76	002351	漫步者	4,050	85,536.00	0.19
77	002581	未名医药	3,000	85,530.00	0.19
78	300118	东方日升	5,700	85,500.00	0.19
79	300188	美亚柏科	4,300	85,269.00	0.19
80	300078	思创医惠	6,300	85,239.00	0.19
81	000034	神州数码	3,500	85,190.00	0.19
82	000735	罗牛山	8,300	84,992.00	0.19
83	603638	艾迪精密	1,606	84,154.40	0.19
84	002025	航天电器	2,300	84,134.00	0.19
85	002643	万润股份	4,900	84,133.00	0.19
86	300766	每日互动	2,200	83,732.00	0.19
87	002036	联创电子	6,675	83,437.50	0.19
88	600546	山煤国际	7,100	83,425.00	0.19
89	002151	北斗星通	2,600	83,278.00	0.19
90	002023	海特高新	5,400	82,998.00	0.19
91	300363	博腾股份	2,400	82,944.00	0.19
92	603127	昭衍新药	780	82,001.40	0.19
93	600459	贵研铂业	2,750	81,977.50	0.19
94	002912	中新赛克	500	81,795.00	0.18
95	002706	良信电器	4,900	81,732.00	0.18
96	000035	中国天楹	15,900	81,090.00	0.18
97	300298	三诺生物	2,500	80,350.00	0.18
98	600252	中恒集团	25,000	80,250.00	0.18
99	002697	红旗连锁	7,300	79,716.00	0.18
100	002497	雅化集团	8,600	79,378.00	0.18
101	600635	大众公用	17,400	79,344.00	0.18
102	600702	舍得酒业	2,100	78,435.00	0.18
103	002262	恩华药业	4,600	77,556.00	0.18
104	600797	浙大网新	9,400	77,456.00	0.17

105	300458	全志科技	2,100	77,280.00	0.17
106	002063	远光软件	6,100	77,043.00	0.17
107	300098	高新兴	12,700	76,962.00	0.17
108	002413	雷科防务	9,900	76,032.00	0.17
109	000951	中国重汽	2,400	75,024.00	0.17
110	600267	海正药业	5,200	74,620.00	0.17
111	300526	中潜股份	600	74,520.00	0.17
112	300702	天宇股份	700	74,424.00	0.17
113	600206	有研新材	5,300	74,041.00	0.17
114	600559	老白干酒	5,700	73,815.00	0.17
115	600621	华鑫股份	3,800	73,340.00	0.17
116	300352	北信源	10,400	73,320.00	0.17
117	600966	博汇纸业	7,200	73,080.00	0.17
118	300031	宝通科技	2,900	72,616.00	0.16
119	300659	中孚信息	1,200	72,024.00	0.16
120	000733	振华科技	3,200	71,968.00	0.16
121	600330	天通股份	7,200	71,784.00	0.16
122	603039	泛微网络	929	71,774.54	0.16
123	601519	大智慧	8,900	71,734.00	0.16
124	300666	江丰电子	1,200	71,616.00	0.16
125	600211	西藏药业	1,120	71,366.40	0.16
126	000503	国新健康	6,400	71,296.00	0.16
127	600491	龙元建设	8,200	70,848.00	0.16
128	300373	扬杰科技	2,100	70,392.00	0.16
129	300792	壹网壹创	400	69,664.00	0.16
130	002310	东方园林	14,400	69,552.00	0.16
131	300395	菲利华	2,100	69,027.00	0.16
132	002597	金禾实业	3,000	68,910.00	0.16
133	002099	海翔药业	8,700	68,817.00	0.16
134	600517	国网英大	10,300	68,804.00	0.16
135	002389	航天彩虹	5,100	68,595.00	0.15
136	002605	姚记科技	1,800	68,400.00	0.15
137	002326	永太科技	5,560	68,165.60	0.15
138	000851	高鸿股份	8,200	67,814.00	0.15
139	000555	神州信息	4,400	67,672.00	0.15
140	000016	深康佳 A	10,000	67,600.00	0.15
141	300709	精研科技	700	67,305.00	0.15
142	603678	火炬电子	2,400	67,248.00	0.15
143	300770	新媒股份	300	67,098.00	0.15
144	002106	莱宝高科	5,100	67,014.00	0.15
145	002237	恒邦股份	4,900	66,983.00	0.15
146	000903	云内动力	12,400	66,712.00	0.15
147	002022	科华生物	3,700	66,415.00	0.15
148	300525	博思软件	1,800	66,186.00	0.15

149	002851	麦格米特	2,550	66,096.00	0.15
150	300394	天孚通信	1,100	65,505.00	0.15
151	600993	马应龙	2,700	65,475.00	0.15
152	300397	天和防务	2,680	65,418.80	0.15
153	300737	科顺股份	3,300	65,109.00	0.15
154	600601	方正科技	19,700	64,813.00	0.15
155	300132	青松股份	2,800	64,680.00	0.15
156	300233	金城医药	2,100	64,575.00	0.15
157	000917	电广传媒	10,200	64,464.00	0.15
158	300456	赛微电子	2,330	64,354.60	0.15
159	002251	步步高	4,600	64,308.00	0.15
160	000591	太阳能	18,900	63,882.00	0.14
161	002035	华帝股份	6,300	63,819.00	0.14
162	600711	盛屯矿业	12,400	63,736.00	0.14
163	300572	安车检测	1,000	63,550.00	0.14
164	600503	华丽家族	14,400	63,504.00	0.14
165	000582	北部湾港	5,900	63,366.00	0.14
166	603596	伯特利	1,800	63,360.00	0.14
167	603713	密尔克卫	600	62,412.00	0.14
168	600246	万通地产	7,400	62,086.00	0.14
169	300170	汉得信息	6,400	61,568.00	0.14
170	002292	奥飞娱乐	7,300	61,466.00	0.14
171	300079	数码科技	12,900	61,275.00	0.14
172	000667	美好置业	22,200	61,272.00	0.14
173	603393	新天然气	1,660	61,171.00	0.14
174	300083	创世纪	10,300	60,976.00	0.14
175	600131	国网信通	3,200	60,704.00	0.14
176	002079	苏州固锝	4,600	60,582.00	0.14
177	000831	五矿稀土	5,300	60,526.00	0.14
178	601058	赛轮轮胎	17,000	60,010.00	0.14
179	000936	华西股份	4,800	60,000.00	0.14
180	600360	华微电子	6,930	59,875.20	0.14
181	300038	数知科技	7,300	59,568.00	0.13
182	300633	开立医疗	1,500	59,475.00	0.13
183	300751	迈为股份	200	59,392.00	0.13
184	600604	市北高新	6,300	59,283.00	0.13
185	300339	润和软件	5,700	59,109.00	0.13
186	000793	华闻集团	14,300	58,916.00	0.13
187	002698	博实股份	4,600	58,650.00	0.13
188	300068	南都电源	5,500	58,630.00	0.13
189	600093	易见股份	5,000	58,600.00	0.13
190	300523	辰安科技	1,250	58,550.00	0.13
191	600789	鲁抗医药	6,380	58,504.60	0.13
192	300149	量子生物	3,100	58,249.00	0.13

193	000652	泰达股份	9,300	58,125.00	0.13
194	300573	兴齐眼药	400	58,000.00	0.13
195	000810	创维数字	4,800	57,984.00	0.13
196	000006	深振业 A	8,500	57,885.00	0.13
197	300327	中颖电子	1,780	57,672.00	0.13
198	600986	科达股份	11,900	57,477.00	0.13
199	000688	国城矿业	3,100	57,443.00	0.13
200	000875	吉电股份	15,400	57,288.00	0.13
201	002239	奥特佳	14,000	57,120.00	0.13
202	002626	金达威	2,200	57,112.00	0.13
203	000516	国际医学	14,100	57,105.00	0.13
204	002324	普利特	3,800	57,038.00	0.13
205	600803	新奥股份	5,500	56,870.00	0.13
206	601375	中原证券	12,000	56,400.00	0.13
207	600850	华东电脑	2,300	56,373.00	0.13
208	002859	洁美科技	1,880	56,362.40	0.13
209	002261	拓维信息	6,900	56,304.00	0.13
210	300497	富祥药业	2,868	56,126.76	0.13
211	002171	楚江新材	6,000	56,040.00	0.13
212	603588	高能环境	4,800	55,968.00	0.13
213	600864	哈投股份	9,300	55,893.00	0.13
214	000915	山大华特	1,700	55,675.00	0.13
215	002020	京新药业	5,200	55,588.00	0.13
216	002498	汉缆股份	11,900	55,454.00	0.13
217	002850	科达利	800	55,360.00	0.13
218	000789	万年青	4,290	55,212.30	0.12
219	002798	帝欧家居	1,700	55,199.00	0.12
220	000429	粤高速 A	7,800	54,522.00	0.12
221	603613	国联股份	580	54,520.00	0.12
222	300053	欧比特	5,000	54,300.00	0.12
223	002301	齐心集团	3,300	54,186.00	0.12
224	300623	捷捷微电	1,800	54,090.00	0.12
225	603236	移远通信	260	54,080.00	0.12
226	002421	达实智能	13,900	53,932.00	0.12
227	000049	德赛电池	1,100	53,911.00	0.12
228	600756	浪潮软件	2,900	53,650.00	0.12
229	002428	云南锗业	4,700	53,580.00	0.12
230	600057	厦门象屿	9,700	53,156.00	0.12
231	002254	泰和新材	3,900	53,040.00	0.12
231	603308	应流股份	2,600	53,040.00	0.12
232	600612	老凤祥	1,100	53,009.00	0.12
233	603718	海利生物	2,900	52,954.00	0.12
234	300406	九强生物	2,300	52,900.00	0.12
235	300663	科蓝软件	1,900	52,649.00	0.12

236	603368	柳药股份	2,280	52,326.00	0.12
237	002777	久远银海	1,720	52,305.20	0.12
238	300123	亚光科技	4,540	52,073.80	0.12
239	600456	宝钛股份	1,900	51,965.00	0.12
240	300568	星源材质	2,763	51,447.06	0.12
241	600868	梅雁吉祥	17,000	51,340.00	0.12
242	601222	林洋能源	9,400	51,324.00	0.12
243	000902	新洋丰	5,800	51,272.00	0.12
244	300085	银之杰	3,200	51,264.00	0.12
245	002042	华孚时尚	8,200	51,086.00	0.12
245	600320	振华重工	17,800	51,086.00	0.12
246	002449	国星光电	4,400	51,040.00	0.12
247	300735	光弘科技	2,766	51,032.70	0.12
248	603606	东方电缆	3,500	50,890.00	0.11
249	002091	江苏国泰	8,400	50,820.00	0.11
250	600685	中船防务	3,000	50,730.00	0.11
251	603323	苏农银行	11,390	50,571.60	0.11
252	600110	诺德股份	10,300	50,264.00	0.11
253	600771	广誉远	3,580	50,227.40	0.11
254	600490	鹏欣资源	15,900	50,085.00	0.11
255	300748	金力永磁	1,500	50,070.00	0.11
256	300143	盈康生命	3,000	50,040.00	0.11
257	300045	华力创通	3,900	50,037.00	0.11
258	603258	电魂网络	900	50,004.00	0.11
259	000070	特发信息	5,140	49,960.80	0.11
260	603118	共进股份	4,200	49,938.00	0.11
261	603601	再升科技	3,800	49,780.00	0.11
262	300429	强力新材	2,780	49,706.40	0.11
263	300322	硕贝德	2,900	49,706.00	0.11
264	002430	杭氧股份	3,500	49,700.00	0.11
265	002194	武汉凡谷	2,400	49,680.00	0.11
266	600363	联创光电	3,200	49,568.00	0.11
267	600129	太极集团	3,500	49,490.00	0.11
268	300638	广和通	820	49,282.00	0.11
269	603018	中设集团	5,060	49,233.80	0.11
270	002959	小熊电器	400	49,200.00	0.11
271	600378	昊华科技	2,400	49,176.00	0.11
272	600337	美克家居	11,100	49,062.00	0.11
273	300815	玉禾田	400	49,056.00	0.11
274	300319	麦捷科技	4,400	48,884.00	0.11
275	603043	广州酒家	1,500	48,780.00	0.11
276	000921	海信家电	4,000	48,640.00	0.11
277	300398	飞凯材料	2,300	48,576.00	0.11
278	601137	博威合金	3,100	48,484.00	0.11

279	603387	基蛋生物	1,200	48,348.00	0.11
280	000976	华铁股份	8,600	47,988.00	0.11
281	002531	天顺风能	8,000	47,840.00	0.11
282	000931	中 关 村	4,700	47,658.00	0.11
283	300292	吴通控股	9,200	47,564.00	0.11
284	002222	福晶科技	3,100	47,554.00	0.11
285	600562	国睿科技	3,200	47,424.00	0.11
286	000823	超声电子	3,400	47,294.00	0.11
287	300303	聚飞光电	8,000	47,120.00	0.11
288	300607	拓斯达	1,153	46,915.57	0.11
289	000901	航天科技	4,600	46,874.00	0.11
290	600422	昆药集团	4,800	46,848.00	0.11
291	300203	聚光科技	2,800	46,844.00	0.11
292	002950	奥美医疗	1,650	46,827.00	0.11
293	000650	仁和药业	7,800	46,800.00	0.11
294	002168	惠程科技	5,700	46,797.00	0.11
295	600210	紫江企业	10,900	46,761.00	0.11
296	300020	银江股份	4,100	46,740.00	0.11
297	300624	万兴科技	580	46,690.00	0.11
298	000910	大亚圣象	3,000	46,620.00	0.11
299	600055	万东医疗	2,900	46,429.00	0.10
300	002276	万马股份	6,500	46,410.00	0.10
301	002291	星期六	2,000	46,200.00	0.10
302	300185	通裕重工	23,500	46,060.00	0.10
303	000683	远兴能源	24,700	45,942.00	0.10
304	002446	盛路通信	6,400	45,760.00	0.10
305	300284	苏交科	6,140	45,681.60	0.10
306	600662	强生控股	5,700	45,486.00	0.10
307	002747	埃斯顿	3,800	45,448.00	0.10
308	300263	隆华科技	5,700	45,429.00	0.10
309	002695	煌上煌	1,800	45,396.00	0.10
310	000546	金圆股份	4,500	45,315.00	0.10
311	600761	安徽合力	4,700	45,308.00	0.10
312	002145	中核钛白	10,000	45,200.00	0.10
313	600668	尖峰集团	3,100	45,198.00	0.10
314	002055	得润电子	3,000	45,180.00	0.10
315	600587	新华医疗	2,900	45,124.00	0.10
316	002459	晶澳科技	2,400	45,072.00	0.10
317	002312	三泰控股	9,900	45,045.00	0.10
318	300602	飞荣达	1,369	44,930.58	0.10
319	600116	三峡水利	5,000	44,450.00	0.10
320	600420	现代制药	4,600	44,298.00	0.10
321	002320	海峡股份	4,025	44,275.00	0.10
322	600108	亚盛集团	14,000	44,240.00	0.10

323	600326	西藏天路	6,200	44,144.00	0.10
324	600072	中船科技	4,000	43,920.00	0.10
325	600596	新安股份	5,100	43,860.00	0.10
326	002649	博彦科技	4,700	43,710.00	0.10
327	603826	坤彩科技	1,300	43,641.00	0.10
328	600496	精工钢构	13,000	43,550.00	0.10
329	600284	浦东建设	7,000	43,050.00	0.10
330	300232	洲明科技	5,320	43,038.80	0.10
331	002545	东方铁塔	5,600	43,008.00	0.10
332	600750	江中药业	3,400	42,976.00	0.10
333	300377	赢时胜	4,600	42,964.00	0.10
334	600624	复旦复华	4,300	42,957.00	0.10
335	002115	三维通信	4,470	42,912.00	0.10
336	002530	金财互联	3,500	42,840.00	0.10
336	002567	唐人神	4,500	42,840.00	0.10
337	002376	新北洋	4,200	42,798.00	0.10
338	300287	飞利信	10,300	42,745.00	0.10
339	002547	春兴精工	6,000	42,720.00	0.10
340	002610	爱康科技	32,100	42,693.00	0.10
341	002104	恒宝股份	5,000	42,550.00	0.10
342	002240	威华股份	3,300	42,471.00	0.10
343	601567	三星医疗	6,200	42,470.00	0.10
344	300664	鹏鹞环保	4,600	42,458.00	0.10
345	002161	远望谷	5,300	42,400.00	0.10
346	300761	立华股份	1,100	42,394.00	0.10
347	000933	神火股份	10,200	42,330.00	0.10
348	600226	*ST 瀚叶	18,000	42,300.00	0.10
349	603489	八方股份	300	42,297.00	0.10
350	000969	安泰科技	6,400	42,240.00	0.10
351	603599	广信股份	2,500	42,175.00	0.10
352	600602	云赛智联	5,800	42,108.00	0.10
353	300616	尚品宅配	700	42,056.00	0.09
354	600200	江苏吴中	6,400	42,048.00	0.09
355	600499	科达制造	10,200	42,024.00	0.09
356	603429	集友股份	1,320	42,015.60	0.09
357	601929	吉视传媒	19,600	41,944.00	0.09
358	603533	掌阅科技	1,100	41,943.00	0.09
359	600477	杭萧钢构	11,540	41,890.20	0.09
360	002918	蒙娜丽莎	1,400	41,874.00	0.09
361	002043	兔宝宝	4,900	41,797.00	0.09
362	002139	拓邦股份	7,400	41,662.00	0.09
363	002717	岭南股份	9,650	41,495.00	0.09
364	000088	盐田港	7,000	41,440.00	0.09
365	601010	文峰股份	13,300	41,363.00	0.09

366	300177	中海达	4,250	41,352.50	0.09
367	600783	鲁信创投	2,700	41,310.00	0.09
368	002596	海南瑞泽	6,200	41,292.00	0.09
368	603108	润达医疗	3,100	41,292.00	0.09
369	000036	华联控股	9,380	41,272.00	0.09
370	002135	东南网架	5,600	41,160.00	0.09
371	300672	国科微	800	41,128.00	0.09
372	300131	英唐智控	7,700	41,118.00	0.09
373	300075	数字政通	3,100	41,075.00	0.09
374	603583	捷昌驱动	600	41,028.00	0.09
375	002258	利尔化学	2,300	41,009.00	0.09
376	600936	广西广电	10,600	40,810.00	0.09
377	002484	江海股份	4,400	40,788.00	0.09
378	600318	新力金融	3,200	40,768.00	0.09
379	300299	富春股份	4,500	40,725.00	0.09
380	300184	力源信息	6,400	40,704.00	0.09
381	002298	中电兴发	5,000	40,650.00	0.09
381	002364	中恒电气	3,000	40,650.00	0.09
382	000560	我爱我家	12,700	40,640.00	0.09
383	603989	艾华集团	1,400	40,628.00	0.09
384	002097	山河智能	6,800	40,596.00	0.09
385	300741	华宝股份	1,100	40,568.00	0.09
386	002041	登海种业	3,200	40,480.00	0.09
387	000676	智度股份	4,740	40,479.60	0.09
388	002733	雄韬股份	1,900	40,375.00	0.09
389	000030	富奥股份	6,300	40,257.00	0.09
390	300119	瑞普生物	1,800	40,230.00	0.09
391	601588	北辰实业	14,300	40,183.00	0.09
392	600059	古越龙山	4,300	40,076.00	0.09
393	001696	宗申动力	6,200	39,928.00	0.09
394	600114	东睦股份	3,840	39,859.20	0.09
395	300194	福安药业	7,500	39,825.00	0.09
396	000697	炼石航空	4,200	39,816.00	0.09
397	002832	比音勒芬	2,320	39,718.40	0.09
398	600851	海欣股份	5,300	39,591.00	0.09
399	600742	一汽富维	4,810	39,538.20	0.09
400	600063	皖维高新	12,100	39,446.00	0.09
401	300034	钢研高纳	2,100	39,396.00	0.09
402	600831	广电网络	5,100	39,372.00	0.09
403	002617	露笑科技	8,100	39,366.00	0.09
404	300679	电连技术	1,230	39,335.40	0.09
405	002768	国恩股份	1,200	39,324.00	0.09
406	000989	九 芝 堂	3,900	39,312.00	0.09
407	600391	航发科技	2,100	39,291.00	0.09

408	300438	鹏辉能源	2,250	39,262.50	0.09
409	002182	云海金属	4,100	39,114.00	0.09
410	002582	好想你	3,200	39,072.00	0.09
411	600512	腾达建设	14,300	39,039.00	0.09
412	002489	浙江永强	9,800	39,004.00	0.09
413	002515	金字火腿	6,200	38,936.00	0.09
414	601666	平煤股份	10,400	38,896.00	0.09
415	000059	华锦股份	8,600	38,872.00	0.09
416	601908	京运通	8,900	38,804.00	0.09
417	002383	合众思壮	4,000	38,760.00	0.09
418	002672	东江环保	4,300	38,743.00	0.09
419	603636	南威软件	3,200	38,720.00	0.09
420	002308	威创股份	5,700	38,703.00	0.09
421	300101	振芯科技	3,500	38,675.00	0.09
422	300455	康拓红外	2,600	38,610.00	0.09
423	601011	宝泰隆	10,100	38,582.00	0.09
424	601163	三角轮胎	2,900	38,396.00	0.09
425	002585	双星新材	6,100	38,369.00	0.09
426	002117	东港股份	3,400	38,352.00	0.09
427	600285	羚锐制药	4,100	38,335.00	0.09
428	300552	万集科技	900	38,322.00	0.09
429	300596	利安隆	1,100	38,313.00	0.09
430	002197	证通电子	3,700	38,295.00	0.09
431	002611	东方精工	8,300	38,263.00	0.09
432	600846	同济科技	4,500	38,250.00	0.09
433	600740	山西焦化	8,840	38,188.80	0.09
434	300256	星星科技	6,000	38,040.00	0.09
435	002539	云图控股	5,500	37,950.00	0.09
436	300055	万邦达	6,200	37,944.00	0.09
437	002967	广电计量	1,400	37,940.00	0.09
438	300145	中金环境	12,100	37,752.00	0.09
439	601369	陕鼓动力	6,000	37,740.00	0.09
440	603222	济民制药	1,100	37,730.00	0.09
441	300016	北陆药业	3,100	37,696.00	0.09
442	000796	凯撒旅业	3,600	37,584.00	0.08
443	600197	伊力特	1,900	37,563.00	0.08
444	002367	康力电梯	4,300	37,539.00	0.08
445	603218	日月股份	2,040	37,332.00	0.08
446	002657	中科金财	2,400	37,272.00	0.08
447	300401	花园生物	2,600	37,258.00	0.08
448	603609	禾丰牧业	2,500	37,250.00	0.08
449	603690	至纯科技	900	37,242.00	0.08
450	300171	东富龙	2,300	37,214.00	0.08
451	002313	日海智能	2,000	37,200.00	0.08

452	603920	世运电路	1,500	37,185.00	0.08
453	300248	新开普	3,000	37,080.00	0.08
454	600510	黑牡丹	4,700	37,036.00	0.08
455	002609	捷顺科技	2,900	36,975.00	0.08
456	300267	尔康制药	9,300	36,921.00	0.08
457	603666	亿嘉和	420	36,859.20	0.08
458	603113	金能科技	3,100	36,859.00	0.08
459	600611	大众交通	9,800	36,848.00	0.08
460	002822	中装建设	4,300	36,808.00	0.08
461	000900	现代投资	9,600	36,768.00	0.08
462	300229	拓尔思	3,200	36,736.00	0.08
463	000829	天音控股	5,600	36,680.00	0.08
464	600269	赣粤高速	10,500	36,645.00	0.08
465	300328	宜安科技	3,050	36,508.50	0.08
466	002047	宝鹰股份	7,200	36,432.00	0.08
467	000603	盛达资源	3,100	36,425.00	0.08
468	002512	达华智能	7,200	36,360.00	0.08
469	300448	浩云科技	3,800	36,290.00	0.08
470	000926	福星股份	6,900	36,225.00	0.08
471	300657	弘信电子	1,800	36,126.00	0.08
472	002130	沃尔核材	7,900	36,103.00	0.08
473	300219	鸿利智汇	3,800	36,062.00	0.08
474	000836	富通鑫茂	10,900	35,970.00	0.08
475	300353	东土科技	3,200	35,904.00	0.08
476	600502	安徽建工	9,300	35,898.00	0.08
477	300310	宜通世纪	6,400	35,840.00	0.08
478	300590	移为通信	1,100	35,816.00	0.08
479	300130	新国都	2,600	35,750.00	0.08
479	600552	凯盛科技	5,500	35,750.00	0.08
480	000592	平潭发展	13,800	35,742.00	0.08
481	600990	四创电子	900	35,730.00	0.08
482	000682	东方电子	7,200	35,712.00	0.08
483	002341	新纶科技	7,300	35,697.00	0.08
484	300755	华致酒行	1,100	35,640.00	0.08
485	300662	科锐国际	800	35,600.00	0.08
486	002668	奥马电器	7,800	35,490.00	0.08
487	002234	民和股份	1,600	35,488.00	0.08
488	002083	孚日股份	6,600	35,376.00	0.08
489	600366	宁波韵升	6,200	35,340.00	0.08
490	002283	天润工业	8,100	35,235.00	0.08
491	002277	友阿股份	8,800	35,200.00	0.08
492	000720	新能泰山	7,000	35,140.00	0.08
493	601952	苏垦农发	3,700	35,076.00	0.08
494	000795	英洛华	6,100	34,831.00	0.08

495	300158	振东制药	6,500	34,775.00	0.08
496	300007	汉威科技	2,100	34,713.00	0.08
497	603026	石大胜华	1,300	34,697.00	0.08
498	300349	金卡智能	2,300	34,615.00	0.08
499	002550	千红制药	8,000	34,560.00	0.08
500	600636	国新文化	2,800	34,440.00	0.08
501	300495	美尚生态	3,600	34,272.00	0.08
502	002235	安妮股份	4,200	34,230.00	0.08
503	002970	锐明技术	500	34,165.00	0.08
504	600483	福能股份	4,700	34,122.00	0.08
505	300604	长川科技	1,100	33,869.00	0.08
506	601677	明泰铝业	3,900	33,852.00	0.08
507	300238	冠昊生物	1,900	33,839.00	0.08
508	002639	雪人股份	4,900	33,810.00	0.08
509	603298	杭叉集团	3,060	33,721.20	0.08
510	600577	精达股份	12,100	33,638.00	0.08
511	600308	华泰股份	7,300	33,580.00	0.08
512	002565	顺灏股份	6,600	33,528.00	0.08
513	000155	川能动力	6,800	33,524.00	0.08
514	603111	康尼机电	5,400	33,426.00	0.08
515	002488	金固股份	6,300	33,390.00	0.08
516	601918	新集能源	14,000	33,320.00	0.08
517	300047	天源迪科	4,585	33,287.10	0.08
518	002034	旺能环境	1,900	33,136.00	0.07
519	002928	华夏航空	2,200	33,110.00	0.07
520	002869	金溢科技	500	33,040.00	0.07
521	300183	东软载波	2,100	32,949.00	0.07
522	600239	云南城投	8,600	32,938.00	0.07
523	600105	永鼎股份	7,800	32,916.00	0.07
524	600764	中国海防	1,300	32,890.00	0.07
525	300044	赛为智能	4,900	32,879.00	0.07
526	002318	久立特材	4,500	32,850.00	0.07
527	002479	富春环保	5,600	32,816.00	0.07
528	002618	丹邦科技	3,400	32,810.00	0.07
529	603363	傲农生物	1,400	32,718.00	0.07
530	300137	先河环保	4,900	32,683.00	0.07
531	002073	软控股份	8,400	32,676.00	0.07
532	002279	久其软件	4,500	32,625.00	0.07
533	300209	天泽信息	1,900	32,604.00	0.07
534	002522	浙江众成	4,900	32,536.00	0.07
534	002537	海联金汇	5,600	32,536.00	0.07
535	300386	飞天诚信	1,900	32,528.00	0.07
536	600480	凌云股份	2,900	32,480.00	0.07
537	601890	亚星锚链	6,000	32,460.00	0.07

538	000913	钱江摩托	2,400	32,328.00	0.07
539	002226	江南化工	5,600	32,312.00	0.07
540	300441	鲍斯股份	3,000	32,310.00	0.07
541	600975	新五丰	3,500	32,270.00	0.07
542	603068	博通集成	400	32,232.00	0.07
543	300266	兴源环境	9,800	32,144.00	0.07
544	002755	奥赛康	1,700	32,130.00	0.07
545	000801	四川九洲	5,500	32,120.00	0.07
546	002838	道恩股份	1,100	32,109.00	0.07
547	300477	合纵科技	4,560	32,102.40	0.07
548	002474	榕基软件	4,500	32,085.00	0.07
549	300224	正海磁材	3,700	32,042.00	0.07
550	000973	佛塑科技	6,900	32,016.00	0.07
551	600736	苏州高新	6,200	31,992.00	0.07
552	603128	华贸物流	5,500	31,955.00	0.07
553	600550	保变电气	6,600	31,878.00	0.07
554	603185	上机数控	650	31,843.50	0.07
555	600103	青山纸业	16,670	31,839.70	0.07
556	601069	西部黄金	2,300	31,809.00	0.07
557	600855	航天长峰	2,000	31,800.00	0.07
558	600449	宁夏建材	2,600	31,772.00	0.07
559	300613	富瀚微	280	31,724.00	0.07
560	603887	城地股份	1,300	31,720.00	0.07
561	300190	维尔利	4,200	31,710.00	0.07
562	002573	清新环境	5,800	31,668.00	0.07
563	300222	科大智能	3,900	31,629.00	0.07
564	600622	光大嘉宝	8,020	31,518.60	0.07
565	601965	中国汽研	3,600	31,392.00	0.07
566	002556	辉隆股份	3,800	31,388.00	0.07
567	002108	沧州明珠	9,000	31,230.00	0.07
567	300684	中石科技	900	31,230.00	0.07
568	300355	蒙草生态	11,600	31,204.00	0.07
569	000601	韶能股份	5,900	31,093.00	0.07
570	600400	红豆股份	9,160	30,960.80	0.07
571	000507	珠海港	5,900	30,916.00	0.07
572	000597	东北制药	5,905	30,824.10	0.07
573	300114	中航电测	2,700	30,807.00	0.07
574	603060	国检集团	1,540	30,784.60	0.07
575	600169	太原重工	16,100	30,751.00	0.07
576	002792	通宇通讯	1,250	30,725.00	0.07
577	002737	葵花药业	2,100	30,723.00	0.07
577	300039	上海凯宝	5,700	30,723.00	0.07
578	603305	旭升股份	800	30,624.00	0.07
579	300726	宏达电子	1,100	30,591.00	0.07

580	600676	交运股份	5,500	30,580.00	0.07
581	600531	豫光金铅	7,800	30,576.00	0.07
582	000918	嘉凯城	6,500	30,550.00	0.07
583	600523	贵航股份	1,800	30,528.00	0.07
584	600300	维维股份	10,400	30,472.00	0.07
585	000011	深物业 A	1,900	30,400.00	0.07
586	300783	三只松鼠	400	30,392.00	0.07
587	002726	龙大肉食	3,600	30,384.00	0.07
588	000726	鲁 泰 A	4,000	30,320.00	0.07
589	300311	任子行	4,300	30,315.00	0.07
590	002204	大连重工	7,000	30,100.00	0.07
591	002067	景兴纸业	9,900	30,096.00	0.07
592	002461	珠江啤酒	3,000	30,060.00	0.07
593	300366	创意信息	3,300	30,030.00	0.07
594	002303	美盈森	6,900	30,015.00	0.07
595	600217	中再资环	6,200	29,884.00	0.07
596	002322	理工环科	2,500	29,800.00	0.07
597	002031	巨轮智能	15,900	29,733.00	0.07
598	300559	佳发教育	1,400	29,708.00	0.07
599	300527	中船应急	3,266	29,622.62	0.07
600	300487	蓝晓科技	900	29,592.00	0.07
601	600075	新疆天业	6,100	29,585.00	0.07
602	002343	慈文传媒	3,400	29,512.00	0.07
603	600775	南京熊猫	3,600	29,484.00	0.07
604	601001	大同煤业	7,500	29,400.00	0.07
605	300603	立昂技术	1,000	29,330.00	0.07
606	600123	兰花科创	6,200	29,202.00	0.07
607	600825	新华传媒	4,700	29,187.00	0.07
608	600495	晋西车轴	7,600	29,184.00	0.07
609	603660	苏州科达	3,180	29,160.60	0.07
610	300531	优博讯	1,400	29,120.00	0.07
611	600963	岳阳林纸	8,200	29,110.00	0.07
612	002215	诺 普 信	4,900	29,106.00	0.07
613	600571	信雅达	3,200	29,088.00	0.07
614	002358	森源电气	5,800	28,942.00	0.07
615	601366	利群股份	4,700	28,717.00	0.06
616	600020	中原高速	8,100	28,674.00	0.06
617	300198	纳川股份	7,400	28,638.00	0.06
618	002017	东信和平	2,400	28,608.00	0.06
618	002307	北新路桥	4,800	28,608.00	0.06
619	002462	嘉事堂	2,100	28,602.00	0.06
620	603688	石英股份	1,200	28,584.00	0.06
621	300388	国祯环保	3,100	28,582.00	0.06
622	601116	三江购物	2,000	28,580.00	0.06

623	002166	莱茵生物	3,600	28,548.00	0.06
624	300065	海兰信	2,900	28,536.00	0.06
624	300336	新文化	5,800	28,536.00	0.06
625	603012	创力集团	4,000	28,520.00	0.06
626	300423	鲁亿通	2,300	28,428.00	0.06
627	300102	乾照光电	6,300	28,350.00	0.06
628	002930	宏川智慧	2,010	28,280.70	0.06
629	600133	东湖高新	5,000	28,250.00	0.06
630	603313	梦百合	1,200	28,236.00	0.06
631	300803	指南针	500	28,215.00	0.06
632	002510	天汽模	6,600	28,116.00	0.06
632	300081	恒信东方	3,300	28,116.00	0.06
633	600708	光明地产	10,000	28,100.00	0.06
634	300393	中来股份	4,200	28,056.00	0.06
635	300409	道氏技术	2,500	28,050.00	0.06
636	000882	华联股份	14,800	27,972.00	0.06
637	300302	同有科技	2,200	27,874.00	0.06
638	300773	拉卡拉	800	27,816.00	0.06
639	002224	三力士	4,600	27,784.00	0.06
640	300571	平治信息	600	27,720.00	0.06
641	600261	阳光照明	7,800	27,690.00	0.06
642	000802	北京文化	4,500	27,585.00	0.06
643	300066	三川智慧	5,600	27,552.00	0.06
644	300332	天壕环境	6,300	27,531.00	0.06
645	002314	南山控股	7,300	27,448.00	0.06
646	002614	奥佳华	2,500	27,425.00	0.06
647	000557	西部创业	7,900	27,413.00	0.06
648	000639	西王食品	4,900	27,391.00	0.06
649	000040	东旭蓝天	9,300	27,342.00	0.06
649	000957	中通客车	4,200	27,342.00	0.06
650	300504	天邑股份	1,000	27,300.00	0.06
651	300091	金通灵	7,700	27,181.00	0.06
652	002746	仙坛股份	2,050	27,162.50	0.06
653	600626	申达股份	5,400	27,054.00	0.06
654	300368	汇金股份	2,800	27,020.00	0.06
655	000935	四川双马	2,100	26,964.00	0.06
656	002158	汉钟精机	1,900	26,885.00	0.06
657	603803	瑞斯康达	2,300	26,864.00	0.06
658	601700	风范股份	5,100	26,826.00	0.06
659	603008	喜临门	2,500	26,825.00	0.06
660	300776	帝尔激光	320	26,809.60	0.06
661	603979	金诚信	2,600	26,806.00	0.06
662	300043	星辉娱乐	6,700	26,800.00	0.06
663	000996	中国中期	3,100	26,784.00	0.06

664	000968	蓝焰控股	3,500	26,775.00	0.06
665	603383	顶点软件	600	26,754.00	0.06
666	000797	中国武夷	7,000	26,740.00	0.06
667	300006	莱美药业	5,100	26,724.00	0.06
668	300323	华灿光电	4,900	26,705.00	0.06
669	603801	志邦家居	1,000	26,690.00	0.06
670	002880	卫光生物	400	26,672.00	0.06
671	600681	百川能源	5,160	26,419.20	0.06
672	600759	洲际油气	14,200	26,412.00	0.06
673	600343	航天动力	3,400	26,384.00	0.06
674	600331	宏达股份	12,800	26,368.00	0.06
675	603337	杰克股份	1,200	26,280.00	0.06
676	300096	易联众	3,100	26,257.00	0.06
677	603220	中贝通信	1,500	26,250.00	0.06
678	300110	华仁药业	6,400	26,240.00	0.06
679	600997	开滦股份	5,700	26,220.00	0.06
680	000958	东方能源	6,300	26,208.00	0.06
681	300765	新诺威	1,160	26,146.40	0.06
682	300740	御家汇	1,900	26,144.00	0.06
683	600773	西藏城投	4,400	26,136.00	0.06
684	300191	潜能恒信	1,400	26,096.00	0.06
685	000751	锌业股份	10,100	26,058.00	0.06
686	002518	科士达	2,100	26,040.00	0.06
687	600894	广日股份	3,800	26,030.00	0.06
688	300300	汉鼎宇佑	4,300	26,015.00	0.06
688	601126	四方股份	4,300	26,015.00	0.06
689	603267	鸿远电子	600	25,950.00	0.06
690	002206	海利得	7,700	25,949.00	0.06
691	002677	浙江美大	2,300	25,944.00	0.06
692	002061	浙江交科	5,000	25,900.00	0.06
693	603367	辰欣药业	1,600	25,872.00	0.06
694	002309	中利集团	4,700	25,850.00	0.06
695	002663	普邦股份	11,300	25,764.00	0.06
696	603595	东尼电子	800	25,760.00	0.06
697	601949	中国出版	4,900	25,725.00	0.06
698	002228	合兴包装	6,400	25,664.00	0.06
699	601330	绿色动力	2,700	25,650.00	0.06
700	601606	长城军工	1,900	25,612.00	0.06
701	002947	恒铭达	400	25,600.00	0.06
702	600987	航民股份	4,780	25,573.00	0.06
703	300762	上海瀚讯	800	25,520.00	0.06
704	000925	众合科技	3,500	25,515.00	0.06
704	603626	科森科技	2,100	25,515.00	0.06
705	000666	经纬纺机	2,800	25,368.00	0.06

706	002519	银河电子	6,100	25,315.00	0.06
707	002335	科华恒盛	1,200	25,308.00	0.06
708	601789	宁波建工	5,300	25,228.00	0.06
708	603399	吉翔股份	3,400	25,228.00	0.06
709	002443	金洲管道	3,700	25,197.00	0.06
710	300276	三丰智能	5,100	25,194.00	0.06
711	600981	汇鸿集团	8,000	25,120.00	0.06
712	000811	冰轮环境	4,000	25,040.00	0.06
713	300785	值得买	199	25,016.29	0.06
714	603458	勘设股份	1,200	24,960.00	0.06
715	600351	亚宝药业	4,900	24,941.00	0.06
716	603508	思维列控	740	24,893.60	0.06
717	300252	金信诺	2,600	24,882.00	0.06
718	002756	永兴材料	1,300	24,817.00	0.06
719	002619	艾格拉斯	10,000	24,800.00	0.06
720	600590	泰豪科技	4,600	24,794.00	0.06
721	002776	柏堡龙	2,900	24,708.00	0.06
722	600096	云天化	5,200	24,700.00	0.06
723	600971	恒源煤电	5,400	24,678.00	0.06
724	002840	华统股份	1,300	24,622.00	0.06
725	002218	拓日新能	6,700	24,455.00	0.06
726	300634	彩讯股份	1,100	24,453.00	0.06
727	002267	陕天然气	4,000	24,440.00	0.06
728	300579	数字认证	600	24,438.00	0.06
729	002274	华昌化工	5,100	24,327.00	0.05
730	002796	世嘉科技	1,150	24,322.50	0.05
731	002344	海宁皮城	5,800	24,302.00	0.05
732	300255	常山药业	4,200	24,234.00	0.05
733	603927	中科软	400	24,176.00	0.05
734	000019	深粮控股	3,000	24,120.00	0.05
735	300788	中信出版	500	24,095.00	0.05
736	002433	太安堂	5,500	24,090.00	0.05
737	600162	香江控股	12,200	24,034.00	0.05
738	300570	太辰光	1,200	24,000.00	0.05
739	300205	天喻信息	2,300	23,920.00	0.05
740	603869	新智认知	2,200	23,914.00	0.05
741	300213	佳讯飞鸿	3,700	23,865.00	0.05
742	002664	长鹰信质	1,800	23,796.00	0.05
743	002029	七匹狼	4,700	23,782.00	0.05
744	600389	江山股份	1,300	23,777.00	0.05
745	600548	深高速	2,600	23,764.00	0.05
746	002913	奥士康	400	23,712.00	0.05
747	000950	重药控股	4,700	23,688.00	0.05
748	002636	金安国纪	2,600	23,686.00	0.05

749	002245	澳洋顺昌	6,100	23,607.00	0.05
750	601886	江河集团	4,100	23,575.00	0.05
751	002833	弘亚数控	960	23,548.80	0.05
752	300533	冰川网络	650	23,517.00	0.05
753	000550	江铃汽车	1,900	23,503.00	0.05
754	002137	麦达数字	3,100	23,436.00	0.05
754	300204	舒泰神	2,100	23,436.00	0.05
755	603359	东珠生态	1,400	23,422.00	0.05
756	600458	时代新材	3,600	23,328.00	0.05
757	603360	百傲化学	1,200	23,316.00	0.05
758	002167	东方锆业	4,500	23,265.00	0.05
759	603590	康辰药业	600	23,256.00	0.05
760	000520	长航凤凰	6,400	23,232.00	0.05
761	603919	金徽酒	1,330	23,128.70	0.05
762	300378	鼎捷软件	1,700	23,120.00	0.05
763	002482	广田集团	6,900	23,115.00	0.05
764	000038	深大通	1,900	23,085.00	0.05
765	002243	通产丽星	1,600	23,040.00	0.05
766	002929	润建股份	800	23,032.00	0.05
767	000665	湖北广电	4,400	23,012.00	0.05
768	600229	城市传媒	3,100	23,002.00	0.05
769	600035	楚天高速	7,600	22,876.00	0.05
770	000544	中原环保	3,500	22,785.00	0.05
771	000532	华金资本	1,900	22,686.00	0.05
772	002229	鸿博股份	3,100	22,599.00	0.05
773	603730	岱美股份	700	22,575.00	0.05
774	600995	文山电力	3,000	22,560.00	0.05
775	300365	恒华科技	2,200	22,440.00	0.05
776	600090	*ST 济堂	7,700	22,330.00	0.05
777	002095	生意宝	1,100	22,220.00	0.05
778	600184	光电股份	2,300	22,172.00	0.05
779	300682	朗新科技	1,300	22,126.00	0.05
780	600810	神马股份	3,100	22,103.00	0.05
781	002542	中化岩土	6,500	22,100.00	0.05
782	000928	中钢国际	5,600	22,008.00	0.05
783	601515	东风股份	3,600	21,996.00	0.05
784	000567	海德股份	1,700	21,862.00	0.05
785	002564	天沃科技	5,500	21,725.00	0.05
786	300061	旗天科技	3,600	21,708.00	0.05
787	603612	索通发展	1,900	21,698.00	0.05
788	601900	南方传媒	2,400	21,696.00	0.05
789	300439	美康生物	1,200	21,684.00	0.05
790	002060	粤水电	7,500	21,675.00	0.05
791	603980	吉华集团	3,100	21,607.00	0.05

792	000620	新华联	6,800	21,556.00	0.05
793	000889	中嘉博创	2,400	21,528.00	0.05
794	300208	青岛中程	3,400	21,352.00	0.05
795	002685	华东重机	3,600	21,240.00	0.05
796	603587	地素时尚	1,260	21,231.00	0.05
797	002305	南国置业	7,800	21,216.00	0.05
797	600136	当代文体	2,600	21,216.00	0.05
798	600603	广汇物流	4,500	21,195.00	0.05
799	002393	力生制药	800	21,096.00	0.05
800	002355	兴民智通	3,900	21,060.00	0.05
801	600581	八一钢铁	6,900	21,045.00	0.05
802	300510	金冠股份	4,779	21,027.60	0.05
803	600800	天津磁卡	4,500	21,015.00	0.05
804	000584	哈工智能	3,800	21,014.00	0.05
805	300215	电科院	3,400	21,012.00	0.05
806	002562	兄弟科技	4,000	21,000.00	0.05
807	300148	天舟文化	5,300	20,988.00	0.05
808	300288	朗玛信息	1,800	20,934.00	0.05
809	600076	康欣新材	6,500	20,930.00	0.05
810	000815	美利云	3,100	20,925.00	0.05
811	600933	爱柯迪	1,500	20,880.00	0.05
812	000615	京汉股份	4,900	20,825.00	0.05
813	002478	常宝股份	4,300	20,769.00	0.05
814	600691	阳煤化工	10,800	20,736.00	0.05
815	600569	安阳钢铁	10,200	20,706.00	0.05
816	002955	鸿合科技	680	20,672.00	0.05
817	300140	中环装备	2,300	20,654.00	0.05
818	000525	红 太 阳	2,600	20,644.00	0.05
819	600322	天房发展	7,900	20,619.00	0.05
820	600533	栖霞建设	5,600	20,496.00	0.05
821	000065	北方国际	2,800	20,468.00	0.05
822	000058	深 赛 格	2,600	20,436.00	0.05
823	600710	苏美达	4,700	20,398.00	0.05
824	600929	湖南盐业	3,300	20,361.00	0.05
825	002516	旷达科技	6,600	20,328.00	0.05
826	603959	百利科技	2,300	20,240.00	0.05
827	603777	来伊份	1,200	20,184.00	0.05
828	300424	航新科技	1,500	20,070.00	0.05
829	002741	光华科技	1,700	20,060.00	0.05
830	600467	好当家	7,900	19,829.00	0.04
831	603357	设计总院	2,000	19,800.00	0.04
832	600897	厦门空港	1,100	19,701.00	0.04
833	601107	四川成渝	5,800	19,662.00	0.04
834	601595	上海电影	1,300	19,604.00	0.04

835	300237	美晨生态	9,100	19,565.00	0.04
836	603728	鸣志电器	1,500	19,560.00	0.04
837	603727	博迈科	1,100	19,525.00	0.04
838	603421	鼎信通讯	1,300	19,474.00	0.04
839	603466	风语筑	1,000	19,470.00	0.04
840	002015	协鑫能科	3,700	19,462.00	0.04
841	300673	佩蒂股份	500	19,440.00	0.04
842	000498	山东路桥	4,000	19,400.00	0.04
843	603105	芯能科技	2,200	19,338.00	0.04
844	600798	宁波海运	6,600	19,272.00	0.04
845	603610	麒盛科技	600	19,248.00	0.04
846	000561	烽火电子	2,700	19,197.00	0.04
847	002284	亚太股份	3,900	19,032.00	0.04
848	002464	众应互联	3,300	18,942.00	0.04
849	600965	福成股份	2,900	18,879.00	0.04
849	601858	中国科传	2,100	18,879.00	0.04
850	300021	大禹节水	4,300	18,877.00	0.04
851	000881	中广核技	2,600	18,876.00	0.04
852	002538	司尔特	3,900	18,759.00	0.04
853	002246	北化股份	2,500	18,700.00	0.04
854	600054	黄山旅游	2,300	18,699.00	0.04
855	300793	佳禾智能	700	18,620.00	0.04
856	600230	沧州大化	2,200	18,590.00	0.04
857	002621	美吉姆	3,020	18,542.80	0.04
858	300768	迪普科技	400	18,516.00	0.04
859	000657	中钨高新	3,100	18,476.00	0.04
860	002631	德尔未来	2,400	18,432.00	0.04
861	002751	易尚展示	800	18,176.00	0.04
862	002712	思美传媒	2,600	18,174.00	0.04
863	002662	京威股份	5,400	18,036.00	0.04
864	000885	城发环境	1,800	17,982.00	0.04
865	601020	华钰矿业	2,300	17,940.00	0.04
866	600715	文投控股	6,700	17,889.00	0.04
867	300109	新开源	1,200	17,772.00	0.04
868	002232	启明信息	1,800	17,658.00	0.04
869	600278	东方创业	1,900	17,613.00	0.04
870	300011	鼎汉技术	3,000	17,610.00	0.04
871	002646	青青稞酒	1,600	17,488.00	0.04
872	000576	广东甘化	2,400	17,448.00	0.04
873	300799	左江科技	200	17,436.00	0.04
874	603299	苏盐井神	2,800	17,276.00	0.04
875	300723	一品红	400	17,236.00	0.04
876	300309	吉艾科技	4,800	17,184.00	0.04
877	002962	五方光电	700	17,101.00	0.04

878	603618	杭电股份	3,100	17,050.00	0.04
879	603896	寿仙谷	500	16,940.00	0.04
880	000821	京山轻机	2,900	16,820.00	0.04
881	000150	宜华健康	4,700	16,732.00	0.04
882	300520	科大国创	900	16,641.00	0.04
883	600242	*ST 中昌	2,600	16,510.00	0.04
884	002101	广东鸿图	2,400	16,488.00	0.04
885	603876	鼎胜新材	1,200	16,380.00	0.04
886	603063	禾望电气	2,300	16,376.00	0.04
887	002345	潮宏基	4,900	16,317.00	0.04
888	000965	天保基建	5,000	16,250.00	0.04
889	002435	长江健康	4,400	16,236.00	0.04
890	000822	山东海化	4,800	16,224.00	0.04
891	601015	陕西黑猫	5,900	16,107.00	0.04
892	603579	荣泰健康	600	16,092.00	0.04
893	600758	辽宁能源	4,800	15,984.00	0.04
894	603169	兰石重装	3,800	15,884.00	0.04
895	002141	贤丰控股	5,100	15,708.00	0.04
896	601101	昊华能源	4,300	15,609.00	0.04
897	603808	歌力思	1,200	15,456.00	0.03
898	603348	文灿股份	800	15,288.00	0.03
899	300307	慈星股份	3,600	15,264.00	0.03
900	000923	河钢资源	1,200	15,120.00	0.03
901	603093	南华期货	700	15,078.00	0.03
902	603711	香飘飘	500	15,055.00	0.03
903	002590	万安科技	2,200	14,982.00	0.03
904	603648	畅联股份	1,700	14,960.00	0.03
905	300176	派生科技	2,800	14,896.00	0.03
906	600876	洛阳玻璃	1,100	14,883.00	0.03
907	600207	安彩高科	3,100	14,849.00	0.03
908	000791	甘肃电投	4,800	14,832.00	0.03
909	600686	金龙汽车	2,600	14,664.00	0.03
910	300262	巴安水务	3,700	14,615.00	0.03
911	300506	名家汇	2,900	14,558.00	0.03
912	002782	可立克	1,100	14,531.00	0.03
913	300777	中简科技	400	14,480.00	0.03
914	600738	兰州民百	2,800	14,476.00	0.03
915	002852	道道全	1,000	14,420.00	0.03
916	002016	世荣兆业	2,200	14,388.00	0.03
917	300771	智莱科技	380	14,364.00	0.03
918	300127	银河磁体	900	14,265.00	0.03
919	000517	荣安地产	5,800	14,210.00	0.03
920	600310	桂东电力	3,700	14,208.00	0.03
921	600618	氯碱化工	2,000	14,200.00	0.03

922	000905	厦门港务	2,200	14,190.00	0.03
923	002451	摩恩电气	2,000	14,180.00	0.03
924	000662	*ST 天夏	5,700	14,136.00	0.03
925	002638	*ST 勤上	6,700	14,070.00	0.03
926	002933	新兴装备	400	14,036.00	0.03
927	002960	青鸟消防	600	13,992.00	0.03
928	603839	安正时尚	1,100	13,970.00	0.03
929	002906	华阳集团	900	13,941.00	0.03
930	002370	亚太药业	2,900	13,804.00	0.03
931	603693	江苏新能	1,100	13,706.00	0.03
932	603318	派思股份	1,800	13,680.00	0.03
933	603619	中曼石油	1,100	13,629.00	0.03
934	000056	皇庭国际	3,400	13,464.00	0.03
934	002895	川恒股份	1,100	13,464.00	0.03
935	600283	钱江水利	1,300	13,377.00	0.03
936	002378	章源钨业	3,300	13,332.00	0.03
937	603180	金牌厨柜	280	13,210.40	0.03
938	001896	豫能控股	4,100	13,202.00	0.03
939	300107	建新股份	2,400	13,152.00	0.03
940	002651	利君股份	2,700	13,068.00	0.03
941	300800	力合科技	400	13,064.00	0.03
942	603327	福蓉科技	500	12,915.00	0.03
943	002377	国创高新	3,300	12,903.00	0.03
944	603053	成都燃气	900	12,861.00	0.03
945	600295	鄂尔多斯	1,800	12,690.00	0.03
946	603915	国茂股份	800	12,296.00	0.03
947	000626	远大控股	2,000	12,180.00	0.03
948	300428	四通新材	800	12,096.00	0.03
949	000711	京蓝科技	3,700	11,803.00	0.03
950	002346	柘中股份	1,200	11,796.00	0.03
951	603390	通达电气	900	11,772.00	0.03
952	603557	起步股份	1,300	11,531.00	0.03
953	000514	渝 开 发	3,000	11,460.00	0.03
954	603530	神马电力	400	11,324.00	0.03
955	002961	瑞达期货	400	11,060.00	0.02
955	603103	横店影视	700	11,060.00	0.02
956	601619	嘉泽新能	3,700	10,804.00	0.02
957	603603	博天环境	1,500	10,350.00	0.02
958	603013	亚普股份	600	9,672.00	0.02
959	603733	仙鹤股份	600	9,642.00	0.02
960	603997	继峰股份	1,400	9,618.00	0.02
961	002973	侨银环保	400	9,376.00	0.02
962	300805	电声股份	400	9,168.00	0.02
963	002759	天际股份	1,400	8,946.00	0.02

964	002907	华森制药	500	8,755.00	0.02
965	300775	三角防务	400	8,656.00	0.02
966	603815	交建股份	400	8,340.00	0.02
967	603956	威派格	500	8,235.00	0.02
968	603279	景津环保	400	8,196.00	0.02
969	603081	大丰实业	700	7,903.00	0.02
970	002911	佛燃能源	500	7,600.00	0.02
971	002951	金时科技	400	7,120.00	0.02
972	002485	希努尔	1,400	6,944.00	0.02
973	600175	退市美都	20,900	6,897.00	0.02
974	603687	大胜达	500	6,885.00	0.02
975	002969	嘉美包装	900	6,867.00	0.02
976	603848	好太太	500	6,825.00	0.02
977	603551	奥普家居	400	6,492.00	0.01
978	603676	卫信康	600	6,486.00	0.01
979	603992	松霖科技	400	6,384.00	0.01
980	600734	*ST 实达	2,700	5,940.00	0.01
981	300798	锦鸡股份	400	5,500.00	0.01
982	300180	华峰超纤	65	556.40	0.00

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	002396	星网锐捷	744,241.00	1.74
2	000540	中天金融	738,645.00	1.72
3	300450	先导智能	702,220.00	1.64
4	002185	华天科技	692,513.00	1.62
5	002405	四维图新	685,888.00	1.60
6	002138	顺络电子	685,476.00	1.60
7	300271	华宇软件	675,843.00	1.58
8	300326	凯利泰	667,911.50	1.56
9	300558	贝达药业	638,452.90	1.49
10	300661	圣邦股份	631,925.00	1.47
11	300496	中科创达	581,662.00	1.36
12	002436	兴森科技	458,650.00	1.07
13	300782	卓胜微	318,187.00	0.74
14	002065	东华软件	206,055.00	0.48
15	603005	晶方科技	128,070.00	0.30

16	600882	妙可蓝多	112,344.00	0.26
17	300598	诚迈科技	111,946.00	0.26
18	300346	南大光电	110,386.00	0.26
19	300674	宇信科技	105,156.00	0.25
20	603520	司太立	101,943.00	0.24

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金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，卖出主要指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，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	002185	华天科技	2,172,309.89	5.07
2	300558	贝达药业	1,888,445.00	4.40
3	002405	四维图新	1,778,134.00	4.15
4	002396	星网锐捷	1,760,905.00	4.11
5	002138	顺络电子	1,759,334.00	4.10
6	300271	华宇软件	1,684,688.35	3.93
7	300661	圣邦股份	1,645,852.00	3.84
8	300450	先导智能	1,642,606.00	3.83
9	000540	中天金融	1,533,170.25	3.58
10	300357	我武生物	1,172,353.99	2.73
11	300212	易华录	1,034,725.60	2.41
12	601916	浙商银行	763,347.10	1.78
13	300496	中科创达	763,081.00	1.78
14	300326	凯利泰	725,308.32	1.69
15	300782	卓胜微	553,345.00	1.29
16	002436	兴森科技	443,114.00	1.03
17	600529	山东药玻	248,471.20	0.58
18	300482	万孚生物	184,252.00	0.43
19	002156	通富微电	174,953.00	0.41
20	300595	欧普康视	169,872.50	0.40

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	36,976,804.68
卖出股票收入（成交）总额	41,406,332.73

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	11,086.83
2	应收证券清算款	420,874.79
3	应收股利	-
4	应收利息	282.31
5	应收申购款	153,161.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	585,405.75

7.12.4 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。

7.12.5 期末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。

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

份额级别	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
广发中证 1000 指数 A	1,603	14,474.41	10,000,800.08	43.10%	13,201,684.00	56.90%
广发中证 1000	1,655	5,796.68	0.00	0.00%	9,593,505.	100.00%

指数 C					95	
合计	3,258	10,066.30	10,000,800.08	30.49%	22,795,189.95	69.51%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发中证 1000 指数 A	11,624.69	0.0501%
	广发中证 1000 指数 C	0.00	0.0000%
	合计	11,624.69	0.0354%

8.3 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发中证 1000 指数 A	0~10
	广发中证 1000 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发中证 1000 指数 A	0~10
	广发中证 1000 指数 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	30.49%	10,000,800.08	30.49%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	11,624.69	0.04%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,012,424.77	30.53%	10,000,800.08	30.49%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 2 日）基金份额总额	14,265,879.01	5,410,288.42
本报告期期初基金份额总额	23,770,465.21	12,698,429.63
本报告期基金总申购份额	14,395,687.49	26,365,948.64
减：本报告期基金总赎回份额	14,963,668.62	29,470,872.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	23,202,484.08	9,593,505.95

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于 2020 年 7 月 11 日发布公告，自 2020 年 7 月 11 日起，邱春杨先生不再担任公司督察长，程才良先生新任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
广发证券	7	17,828,789.01	22.75%	16,604.25	22.75%	-
光大证券	3	60,544,549.38	77.25%	56,383.32	77.25%	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	5	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-

中天证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- （1）财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- （2）经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- （3）具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- （4）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- （5）能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

财富证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-21
2	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27
3	关于旗下基金调整申购（含定期定额投资）及转换转入确认业务规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-28
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-17
5	关于增加陆享基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-16
6	关于增加中邮证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101-20200630	10,000,800.08	-	-	10,000,800.08	30.49%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十七日