

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资 基金

2018 年半年度报告

2018 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

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。

基金托管人中国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 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53

8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	55
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.....	55
9	开放式基金份额变动	55
10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4	基金投资策略的改变.....	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8	其他重大事件.....	57
11	影响投资者决策的其他重要信息	57
12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录.....	58
12.2	存放地点.....	58
12.3	查阅方式.....	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指工业 ETF
场内简称	工业 ETF
基金主代码	159953
交易代码	159953
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 13 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,166,421.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 7 月 14 日

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	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其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动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
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全指工业指数。
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566
传真		020-89899158	010-66594942

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1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1号
邮政编码	510308	100818
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	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	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼、北京市西城区复兴门内大街1号

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1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-1,245,523.90
本期利润	-7,222,317.41
加权平均基金份额本期利润	-0.2077
本期加权平均净值利润率	-23.39%
本期基金份额净值增长率	-21.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-8,154,970.01
期末可供分配基金份额利润	-0.2459
期末基金资产净值	25,011,450.99
期末基金份额净值	0.7541
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-24.59%

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

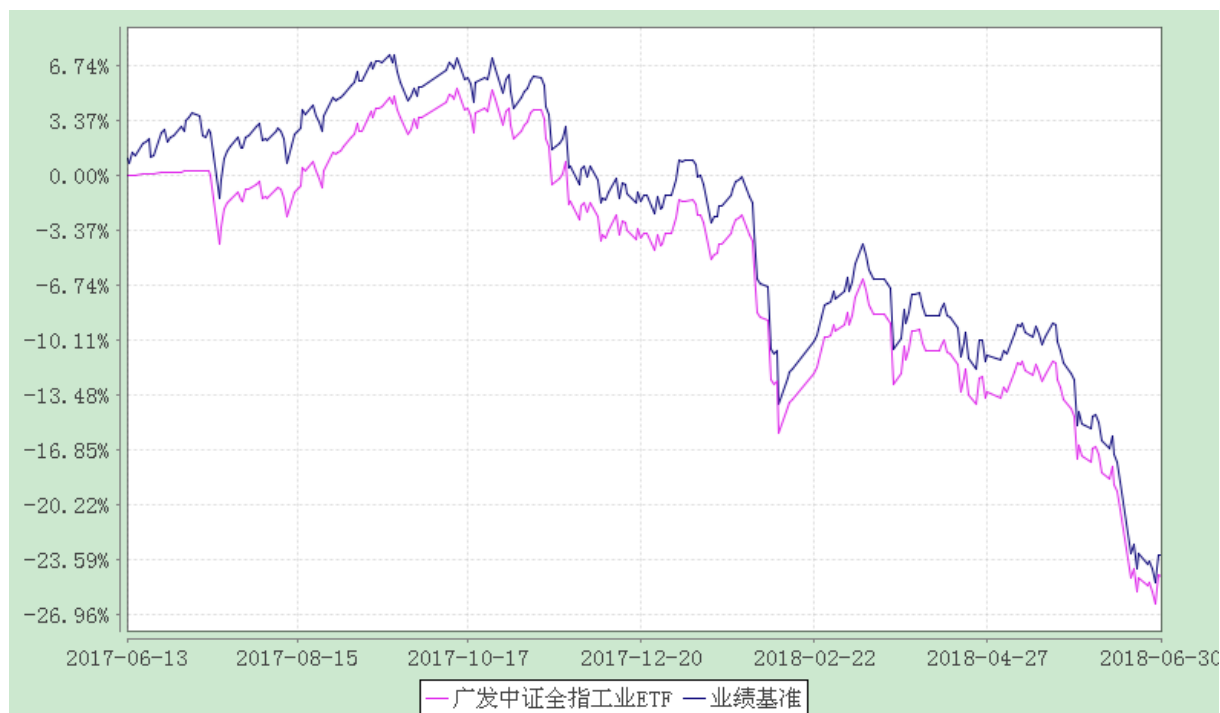
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.63%	1.50%	-10.32%	1.53%	0.69%	-0.03%
过去三个月	-16.62%	1.17%	-17.28%	1.19%	0.66%	-0.02%
过去六个月	-21.77%	1.22%	-22.34%	1.24%	0.57%	-0.02%
过去一年	-24.73%	1.02%	-25.16%	1.04%	0.43%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-24.59%	0.99%	-23.31%	1.02%	-1.28%	-0.03%

注：业绩比较基准：中证全指工业指数。

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

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
 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
 （2017年6月13日至2018年6月30日）



注：本基金建仓期为基金合同生效后 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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、康美药业股份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 30 个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、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、养老金与战略业务部、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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 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）及基金经理助理的简介

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		
陆志明	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费 ETF 基金的基金经理；广发中证全指医药卫生 ETF 基	2017-06-13	-	19 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、广发中小板 300 交易型开放式指数证券

	<p>金的基金经理；广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理；广发信息技术联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理；广发可选消费联接基金的基金经理；广发医药卫生联接基金的基金经理；广发中证全指能源ETF基金的基金经理；广发中证全指原材料ETF基金的基金经理；广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理；广发金融地产联接基金的基金经理；广发能源联接基金的基金经理；广发原材料联接基金的基金经理；广发主要消费联接基金的基金经理；广发中证全指工业ETF联接基金的基金经理；量化投资部副总经理</p>				<p>投资基金基金经理（自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理（自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理（自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日）、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日）。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 6 月 3 日起任职）、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 12 月 1 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 1 月 8 日起任职）、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 1 月 29 日起任职）、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 3 月 23 日起任职）、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 4 月 15 日起任职）、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 5 月 6 日起任职）、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 25 日起任职）、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 25 日起任职）、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资</p>
--	---	--	--	--	---

					基金基金经理（自 2015 年 7 月 1 日起任职）、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 7 月 9 日起任职）、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 7 月 9 日起任职）、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 8 月 18 日起任职）、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2015 年 8 月 18 日起任职）、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 6 月 13 日起任职）、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2017 年 6 月 13 日起任职）。
--	--	--	--	--	--

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》及其配套法规、《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，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，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权

制度，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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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

（1）投资策略

作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差。

（2）运作分析

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。本基金跟踪误差来源主要是申购和赎回因素，作为 ETF 基金，由于本基金规模较小，申购赎回对本基金的跟踪效果有较大影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-21.77%，同期业绩基准收益率为-22.34%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，A 股市场受中美贸易战的反复无常、金融去杠杆的严厉执行以及信用违约事件频发影

响，权益市场有较大幅度的调整。从政府公告的经济数据来看，投资增速特别是基建投资出现了一定程度的下滑，消费增长也有一定的回落，中美贸易战也为出口的增长蒙上了阴影。下半年，政府针对外部环境的变化，将实施积极的财政政策和稳健的货币政策，保持经济运行在合理区间，要做好稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期的工作。经过上半年权益市场的大幅调整，风险得到释放，A 股的估值水平合理偏低，无论从破净的公司数量、公司的业绩增长、增持与回购的企业数量上进行判断，A 股是不错的投资标的之一。

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、估值的副总经理、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、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。

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

本报告期内，本基金于 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 6 月 29 日连续 119 个工作日出现了基金资产

净值低于五千万的情形。

基金管理人已向中国证监会报告此情形，鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金

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
-----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	617,187.41	527,091.88
结算备付金		-	7,465.91
存出保证金		324.46	164,467.08
交易性金融资产	6.4.7.2	24,535,338.61	35,606,437.96
其中：股票投资		24,535,338.61	35,606,437.96
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	96.11	224.94
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		25,152,946.59	36,305,687.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	-	-
应付证券清算款		-	250,960.10
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,798.60	16,983.49
应付托管费		2,159.73	3,396.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		9,441.33	10,305.53
应交税费	6.4.7.7	-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		119,095.94	196,026.00
负债合计	6.4.7.8	141,495.60	477,671.80
所有者权益：			
实收基金		33,166,421.00	37,166,421.00
未分配利润	6.4.7.9	-8,154,970.01	-1,338,405.03
所有者权益合计	6.4.7.10	25,011,450.99	35,828,015.97
负债和所有者权益总计		25,152,946.59	36,305,687.77

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7541 元，基金份额总额 33,166,421.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指工业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 6 月 13 日（基 金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-6,993,078.64	670,565.07
1.利息收入		2,584.88	520,473.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,584.88	520,473.87
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,018,870.01	20,817.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,201,473.24	10,680.00
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	182,603.23	10,137.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,976,793.51	129,274.00
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	-	-
减：二、费用		229,238.77	105,707.21
1. 管理人报酬		76,361.15	67,873.42
2. 托管费		15,272.24	13,574.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	8,194.44	1,027.94
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	129,410.94	23,231.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,222,317.41	564,857.86

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,222,317.41	564,857.86

注：本基金合同生效日为 2017 年 6 月 13 日，上年度可比期间不完整。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指工业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	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）	37,166,421.00	-1,338,405.03	35,828,015.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,222,317.41	-7,222,317.41
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）	-4,000,000.00	405,752.43	-3,594,247.57
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-4,000,000.00	405,752.43	-3,594,247.57
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）	33,166,421.00	-8,154,970.01	25,011,450.99
项目	上年度可比期间 2017 年 6 月 13 日（基金合同生效日）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）	291,166,421.00	-	291,166,421.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	564,857.86	564,857.86
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	291,166,421.00	564,857.86	291,731,278.86

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

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2015] 1447 号文核准，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《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2017 年 6 月 13 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2016 年 5 月 3 日至 2016 年 6 月 5 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 291,166,421.00 元，有效认购户数为 3,345 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 20,306.00 元，折合基金份额 291,166,421.00 份，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。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括：中证全指工业指数的成份股、备选成份股，少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：中证全指工业指数。

本基金的财务报表于 2018 年 8 月 22 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。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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、债券免征营业税或增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2、对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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5、对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	617,187.41
定期存款	-
其他存款	-
合计	617,187.41

6.4.7.2 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	32,336,003.99	24,535,338.61	-7,800,665.38
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	32,336,003.99	24,535,338.61	-7,800,665.38

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	96.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.09
应收结算备付金利息	-
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	-
其他	-
合计	96.11

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	9,441.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,441.33

6.4.7.8 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	-
预提费用	109,095.94
应付指数使用费	10,000.00
合计	119,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,166,421.00	37,166,421.00

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-4,000,000.00	-4,000,000.00
本期末	33,166,421.00	33,166,421.00

6.4.7.10 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	613,458.18	-1,951,863.21	-1,338,405.03
本期利润	-1,245,523.90	-5,976,793.51	-7,222,317.41
本期基金份额交易产生的变动数	-40,968.66	446,721.09	405,752.43
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-40,968.66	446,721.09	405,752.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-673,034.38	-7,481,935.63	-8,154,970.01

6.4.7.11 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	2,301.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	238.00
结算备付金利息收入	45.28
其他	-
合计	2,584.88

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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	-804,609.90
股票投资收益——赎回差价收入	-396,863.34
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,201,473.24

6.4.7.12.2 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	3,134,654.94
减：卖出股票成本总额	3,939,264.84
买卖股票差价收入	-804,609.90

6.4.7.12.3 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	3,594,247.57
减：现金支付赎回款总额	394,423.57
减：赎回股票成本总额	3,596,687.34
赎回差价收入	-396,863.34

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	182,603.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	182,603.23

6.4.7.16 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	-5,976,793.51
——股票投资	-5,976,793.51
——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	-5,976,793.51

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 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	8,194.44
银行间市场交易费用	-
合计	8,194.44

6.4.7.19 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
银行汇划费	315.00
上市费	29,752.78
指数使用费	20,000.00
合计	129,410.94

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

本基金本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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	基金管理人母公司、代销机构
广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年6月13日（基金合同生效日） 至2017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	2,615,715.22	47.29%	-	-

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 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
广发证券股份有限公司	2,436.18	53.33%	2,209.90	23.41%

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年6月13日（基金合同 生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	76,361.15	67,873.42
其中：支付销售机构的客户维护费	355.03	-

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年6月13日（基金合同 生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,272.24	13,574.72

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内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。

6.4.10.3 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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	13,292,509.00	40.08%	16,490,509.00	44.37%

6.4.10.5 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6月13日（基金合同生效 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
中国银行股份有限公司	617,187.41	2,301.60	65,658,716.81	65,578.02

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2018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 2018 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000509	华塑控股	2018-05-30	重大事项停牌	2.83	2018-07-13	2.85	2,400.00	14,482.84	6,792.00	-
603315	福鞍股份	2018-04-09	重大事项停牌	12.44	2018-08-01	13.20	600.00	10,527.69	7,464.00	-
603690	至纯科技	2018-03-12	重大事项停牌	18.29	2018-07-10	20.12	500.00	8,802.80	9,145.00	-
603032	德新交运	2018-06-05	重大事项停牌	14.12	2018-07-27	14.32	720.00	25,913.61	10,166.40	-
300491	通合科技	2018-03-13	重大事项停牌	20.50	2018-07-20	21.00	500.00	15,573.24	10,250.00	-
603016	新宏泰	2018-06-07	重大事项停牌	21.84	-	-	500.00	21,980.00	10,920.00	-
300362	天翔环境	2018-06-08	重大事项停牌	9.68	-	-	1,200.00	18,791.18	11,616.00	-
603085	天成自控	2018-06-15	重大事项停牌	24.62	2018-07-02	22.16	600.00	16,581.00	14,772.00	-
300011	新宁物流	2018-06-15	重大事项停牌	9.86	2018-07-02	9.73	1,500.00	24,291.82	14,790.00	-

3	流	-19	项停牌		7-02						
300510	金冠电气	2018-06-19	重大事项停牌	24.48	-	-	700.00	21,664.69	17,136.00	-	
600784	鲁银投资	2018-01-11	重大事项停牌	5.46	2018-07-09	5.24	3,500.00	23,658.72	19,110.00	-	
300187	永清环保	2018-04-09	重大事项停牌	9.32	-	-	2,100.00	22,764.52	19,572.00	-	
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项停牌	4.81	2018-07-03	5.20	4,100.00	35,051.68	19,721.00	-	
300111	向日葵	2018-06-04	重大事项停牌	2.74	-	-	8,500.00	32,790.87	23,290.00	-	
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事项停牌	18.08	-	-	1,300.00	29,444.12	23,504.00	-	
002611	东方精工	2018-06-19	重大事项停牌	6.17	2018-07-03	6.01	3,840.00	33,893.80	23,692.80	-	
002011	盾安环境	2018-05-02	重大事项停牌	6.40	-	-	3,900.00	41,431.50	24,960.00	-	
002121	科陆电子	2018-06-07	重大事项停牌	6.49	2018-08-06	5.84	4,000.00	37,724.97	25,960.00	-	
000711	京蓝科技	2018-03-26	重大事项停牌	10.02	-	-	2,760.00	29,082.23	27,655.20	-	
300198	纳川股份	2018-02-02	重大事项停牌	5.99	2018-08-02	5.38	4,700.00	41,029.35	28,153.00	-	
000967	盈峰环境	2018-05-18	重大事项停牌	8.70	2018-07-31	8.01	3,300.00	32,691.16	28,710.00	-	
002621	三垒股份	2018-06-07	重大事项停牌	19.49	2018-07-06	17.54	1,500.00	21,158.68	29,235.00	-	
002617	露笑科技	2018-05-09	重大事项停牌	8.15	-	-	3,900.00	41,613.76	31,785.00	-	
002309	中利集团	2018-02-05	重大事项停牌	14.30	2018-07-30	12.78	2,300.00	32,119.38	32,890.00	-	
600217	中再资环	2018-03-29	重大事项停牌	6.13	-	-	5,400.00	38,989.64	33,102.00	-	
000035	中国天楹	2017-08-22	重大事项停牌	6.72	2018-07-09	6.05	5,400.00	36,688.11	36,288.00	-	
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	3,500.00	47,352.49	37,800.00	-	
000022	深赤湾A	2017-11-20	重大事项停牌	22.82	2018-07-10	20.55	1,900.00	56,849.81	43,358.00	-	
002630	华西能源	2018-06-20	重大事项停牌	6.54	-	-	6,780.00	47,172.04	44,341.20	-	
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项停牌	6.71	-	-	7,700.00	79,337.13	51,667.00	-	
002577	清新环	2018-06	重大事	11.55	-	-	4,600.00	89,428.00	53,130.00	-	

3	境	-19	项停牌							
002665	首航节能	2018-05-29	重大事项停牌	5.80	-	-	9,500.00	72,066.30	55,100.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	-	-	10,500.00	97,255.99	56,385.00	-
002610	爱康科技	2018-06-05	重大事项停牌	2.10	-	-	27,000.00	72,015.51	56,700.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项停牌	15.27	-	-	4,000.00	81,393.62	61,080.00	-
002210	飞马国际	2018-03-26	重大事项停牌	12.33	2018-08-13	11.07	5,000.00	56,122.80	61,650.00	-
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项停牌	4.96	2018-08-07	4.46	12,600.00	98,579.75	62,496.00	-
600175	美都能源	2018-05-30	重大事项停牌	4.16	2018-08-17	3.74	16,100.00	77,275.27	66,976.00	-
300090	盛运环保	2018-06-04	重大事项停牌	8.32	2018-07-02	7.49	8,300.00	78,621.50	69,056.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	13,800.00	93,138.12	80,592.00	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项停牌	19.99	2018-07-02	17.99	4,600.00	131,537.17	91,954.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	15.03	-	-	10,100.00	197,400.66	151,803.00	-
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项停牌	6.34	2018-08-07	5.71	26,700.00	206,872.52	169,278.00	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大事项停牌	3.23	2018-07-20	2.91	97,500.00	314,681.72	314,925.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	42,200.00	371,779.00	315,234.00	-

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 2018 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 2018 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。

6.4.13 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裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、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，因此与债券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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

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，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 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	617,187.41	-	-	-	617,187.41
存出保证金	324.46	-	-	-	324.46
交易性金融资产	-	-	-	24,535,338.61	24,535,338.61
应收利息	-	-	-	96.11	96.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	617,511.87	-	-	24,535,434.72	25,152,946.59
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,798.60	10,798.60
应付托管费	-	-	-	2,159.73	2,159.73
应付交易费用	-	-	-	9,441.33	9,441.33
其他负债	-	-	-	119,095.94	119,095.94
负债总计	-	-	-	141,495.60	141,495.60
利率敏感度缺口	617,511.87	-	-	24,393,939.12	25,011,450.99

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	527,091.88	-	-	-	527,091.88
结算备付金	7,465.91	-	-	-	7,465.91
存出保证金	164,467.08	-	-	-	164,467.08
交易性金融资产	-	-	-	35,606,437.96	35,606,437.96
应收利息	-	-	-	224.94	224.94
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	699,024.87	-	-	35,606,662.90	36,305,687.77
负债					
应付证券清算款	-	-	-	250,960.10	250,960.10
应付管理人报酬	-	-	-	16,983.49	16,983.49
应付托管费	-	-	-	3,396.68	3,396.68
应付交易费用	-	-	-	10,305.53	10,305.53
其他负债	-	-	-	196,026.00	196,026.00
负债总计	-	-	-	477,671.80	477,671.80
利率敏感度缺口	699,024.87	-	-	35,128,991.10	35,828,015.97

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。

6.4.13.4.3 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 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	24,535,338.61	98.10	35,606,437.96	99.38
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	24,535,338.61	98.10	35,606,437.96	99.38

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,250,572.55	2,160,661.81
业绩比较基准下降 5%	-1,250,572.55	-2,160,661.81	

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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 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级的余额为 22,151,134.01 元，属于第二层级的余额为 2,384,204.60 元，无属于第三层级的金额（2017 年 12 月

31 日：属于第一层级的余额为 33,692,830.08 元，属于第二层级的余额为 1,913,607.88 元，无属于第三层级的金额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

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	24,535,338.61	97.54
	其中：股票	24,535,338.61	97.54
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	617,187.41	2.45
8	其他各项资产	420.57	0.00
9	合计	25,152,946.59	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项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	13,846.00	0.06

B	采矿业	94,020.90	0.38
C	制造业	12,853,148.63	51.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	150,718.58	0.60
E	建筑业	3,998,209.70	15.99
F	批发和零售业	673,728.52	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	4,297,036.37	17.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,258.00	0.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	705,788.21	2.82
M	科学研究和技术服务业	376,840.80	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	875,212.90	3.50
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	39,180.00	0.16
S	综合	253,350.00	1.01
	合计	24,535,338.61	98.10

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	601668	中国建筑	149,800	817,908.00	3.27
2	601766	中国中车	52,100	401,170.00	1.60
3	600009	上海机场	6,900	382,812.00	1.53
4	601006	大秦铁路	42,400	348,104.00	1.39

5	601390	中国中铁	42,200	315,234.00	1.26
6	600221	海航控股	97,500	314,925.00	1.26
7	000338	潍柴动力	34,500	301,875.00	1.21
8	600031	三一重工	33,000	296,010.00	1.18
9	601186	中国铁建	32,800	282,736.00	1.13
10	601989	中国重工	65,300	263,812.00	1.05
11	601012	隆基股份	13,980	233,326.20	0.93
12	300124	汇川技术	7,100	233,022.00	0.93
13	600029	南方航空	25,000	211,250.00	0.84
14	600406	国电南瑞	11,900	188,020.00	0.75
15	300070	碧水源	13,400	186,662.00	0.75
16	600115	东方航空	28,000	185,360.00	0.74
17	600089	特变电工	26,500	183,645.00	0.73
18	002202	金风科技	14,470	182,900.80	0.73
19	601669	中国电建	32,700	175,272.00	0.70
20	601727	上海电气	26,700	169,278.00	0.68
21	601111	中国国航	18,200	161,798.00	0.65
22	000768	中航飞机	9,900	154,836.00	0.62
23	002310	东方园林	10,100	151,803.00	0.61
24	600893	航发动力	6,400	142,848.00	0.57
25	600068	葛洲坝	19,700	142,037.00	0.57
26	601877	正泰电器	6,100	136,152.00	0.54
27	300024	机器人	7,800	135,720.00	0.54
28	601919	中远海控	27,200	133,824.00	0.54
29	000157	中联重科	32,000	131,520.00	0.53
30	600018	上港集团	21,500	128,140.00	0.51
31	601618	中国中冶	38,200	127,206.00	0.51
32	000425	徐工机械	30,000	127,200.00	0.51
33	601800	中国交建	10,900	124,151.00	0.50
34	601018	宁波港	28,200	118,722.00	0.47
35	002081	金螳螂	11,300	114,130.00	0.46
36	002050	三花智控	6,000	113,100.00	0.45
37	600482	中国动力	6,200	108,190.00	0.43
38	600760	中航沈飞	3,000	108,120.00	0.43
39	600879	航天电子	14,900	104,747.00	0.42
40	002129	中环股份	13,200	103,356.00	0.41
41	601333	广深铁路	24,200	102,850.00	0.41
42	600525	长园集团	9,400	99,358.00	0.40
43	600170	上海建工	31,800	96,672.00	0.39
44	600004	白云机场	7,365	96,407.85	0.39
45	600885	宏发股份	3,220	96,342.40	0.39
46	601117	中国化学	14,100	94,893.00	0.38
47	300266	兴源环境	4,600	91,954.00	0.37
48	600153	建发股份	10,100	90,799.00	0.36

49	000826	启迪桑德	5,100	89,148.00	0.36
50	600884	杉杉股份	4,000	88,400.00	0.35
51	600415	小商品城	19,400	83,614.00	0.33
52	002127	南极电商	8,800	82,632.00	0.33
53	002176	江特电机	8,400	81,648.00	0.33
54	002352	顺丰控股	1,800	81,000.00	0.32
55	000415	渤海金控	13,800	80,592.00	0.32
56	600118	中国卫星	4,200	80,220.00	0.32
57	600038	中直股份	2,000	79,980.00	0.32
58	600820	隧道股份	13,500	79,785.00	0.32
59	000039	中集集团	6,000	79,680.00	0.32
60	002013	中航机电	10,300	77,971.00	0.31
61	601228	广州港	13,200	76,692.00	0.31
62	600711	盛屯矿业	8,400	75,852.00	0.30
63	300450	先导智能	2,496	75,479.04	0.30
64	000009	中国宝安	15,300	74,970.00	0.30
65	600528	中铁工业	7,300	74,606.00	0.30
66	600967	内蒙一机	5,600	71,344.00	0.29
67	002183	怡亚通	10,600	70,490.00	0.28
68	300090	盛运环保	8,300	69,056.00	0.28
69	002074	国轩高科	4,890	68,753.40	0.27
70	600388	龙净环保	5,300	67,734.00	0.27
71	002506	协鑫集成	14,400	67,392.00	0.27
72	600175	美都能源	16,100	66,976.00	0.27
73	601021	春秋航空	1,900	66,557.00	0.27
74	600755	厦门国贸	9,100	66,339.00	0.27
75	300073	当升科技	1,900	64,714.00	0.26
76	300274	阳光电源	7,200	64,584.00	0.26
77	600704	物产中大	12,300	64,329.00	0.26
78	002028	思源电气	3,800	63,802.00	0.26
79	603899	晨光文具	2,000	63,380.00	0.25
80	600875	东方电气	8,500	62,985.00	0.25
81	000008	神州高铁	12,600	62,496.00	0.25
82	600499	科达洁能	9,000	61,740.00	0.25
83	002210	飞马国际	5,000	61,650.00	0.25
84	002051	中工国际	4,000	61,080.00	0.24
85	002372	伟星新材	3,420	60,499.80	0.24
86	600787	中储股份	7,800	60,372.00	0.24
87	300316	晶盛机电	4,540	60,336.60	0.24
88	000528	柳工	5,600	59,976.00	0.24
89	002341	新纶科技	4,500	59,805.00	0.24
90	002168	深圳惠程	5,800	59,624.00	0.24
91	300203	聚光科技	2,300	58,880.00	0.24
92	603885	吉祥航空	3,800	58,558.00	0.23

93	002610	爱康科技	27,000	56,700.00	0.23
94	300197	铁汉生态	10,500	56,385.00	0.23
95	601866	中远海发	22,600	56,274.00	0.22
96	000089	深圳机场	7,300	55,845.00	0.22
97	002665	首航节能	9,500	55,100.00	0.22
98	300014	亿纬锂能	3,100	54,560.00	0.22
99	300012	华测检测	9,500	54,530.00	0.22
100	601872	招商轮船	15,100	54,511.00	0.22
101	600270	外运发展	2,600	54,496.00	0.22
102	600125	铁龙物流	6,500	54,405.00	0.22
103	002023	海特高新	4,300	53,922.00	0.22
104	002573	清新环境	4,600	53,130.00	0.21
105	002120	韵达股份	1,000	53,050.00	0.21
106	300355	蒙草生态	8,800	52,888.00	0.21
107	002366	台海核电	3,700	52,762.00	0.21
108	600435	北方导航	6,400	52,224.00	0.21
109	002431	棕榈股份	7,700	51,667.00	0.21
110	600575	皖江物流	13,900	51,569.00	0.21
111	600323	瀚蓝环境	3,300	50,226.00	0.20
112	600970	中材国际	7,500	50,100.00	0.20
113	601179	中国西电	14,600	49,932.00	0.20
114	601000	唐山港	21,130	49,655.50	0.20
115	600372	中航电子	3,800	49,628.00	0.20
116	300207	欣旺达	5,500	49,555.00	0.20
117	600320	振华重工	11,800	49,442.00	0.20
118	300055	万邦达	4,300	49,407.00	0.20
119	600648	外高桥	2,700	49,356.00	0.20
120	600179	安通控股	4,840	49,029.20	0.20
121	002191	劲嘉股份	6,400	47,808.00	0.19
122	000697	炼石有色	3,200	45,952.00	0.18
123	600717	天津港	6,000	45,180.00	0.18
124	002358	森源电气	3,000	45,150.00	0.18
125	002630	华西能源	6,780	44,341.20	0.18
126	601611	中国核建	5,600	44,240.00	0.18
127	000738	航发控制	3,300	43,989.00	0.18
128	600835	上海机电	2,300	43,378.00	0.17
129	000022	深赤湾 A	1,900	43,358.00	0.17
130	002672	东江环保	3,300	43,197.00	0.17
131	600110	诺德股份	8,200	42,886.00	0.17
132	601880	大连港	22,100	42,874.00	0.17
133	002266	浙富控股	11,300	42,375.00	0.17
134	600017	日照港	13,200	42,372.00	0.17
135	600039	四川路桥	12,900	42,312.00	0.17
136	000507	珠海港	4,500	42,210.00	0.17

137	002444	巨星科技	3,800	41,838.00	0.17
138	002025	航天电器	1,800	41,580.00	0.17
139	600026	中远海能	9,800	41,552.00	0.17
140	002056	横店东磁	5,900	41,359.00	0.17
141	300159	新研股份	5,800	41,064.00	0.16
142	300001	特锐德	3,600	40,896.00	0.16
143	600120	浙江东方	2,990	40,514.50	0.16
144	002595	豪迈科技	2,300	39,997.00	0.16
145	300145	中金环境	5,100	39,933.00	0.16
146	601200	上海环境	2,500	39,575.00	0.16
147	300101	振芯科技	2,800	39,564.00	0.16
148	300222	科大智能	2,100	38,934.00	0.16
149	600582	天地科技	10,600	38,902.00	0.16
150	600057	厦门象屿	7,699	38,418.01	0.15
151	300568	星源材质	1,000	38,210.00	0.15
152	601100	恒立液压	1,820	38,001.60	0.15
153	601222	林洋能源	7,600	37,848.00	0.15
154	300118	东方日升	3,500	37,800.00	0.15
155	002468	申通快递	2,200	37,730.00	0.15
156	300237	美晨生态	5,220	37,479.60	0.15
157	300208	恒顺众昇	3,800	37,278.00	0.15
158	600478	科力远	7,300	37,230.00	0.15
159	601717	郑煤机	6,400	37,184.00	0.15
160	300068	南都电源	3,100	37,138.00	0.15
161	601567	三星医疗	5,100	37,128.00	0.15
162	300257	开山股份	2,400	36,696.00	0.15
163	002249	大洋电机	8,500	36,635.00	0.15
164	002389	南洋科技	2,700	36,558.00	0.15
165	600477	杭萧钢构	7,630	36,547.70	0.15
166	000035	中国天楹	5,400	36,288.00	0.15
167	000088	盐田港	5,500	36,245.00	0.14
168	300376	易事特	6,600	35,442.00	0.14
169	600200	江苏吴中	4,700	35,438.00	0.14
170	601828	美凯龙	2,300	35,144.00	0.14
171	600580	卧龙电气	4,600	35,052.00	0.14
172	000519	中兵红箭	4,500	34,965.00	0.14
173	600990	四创电子	700	34,524.00	0.14
174	002130	沃尔核材	7,900	34,444.00	0.14
175	600577	精达股份	9,800	34,006.00	0.14
176	600269	赣粤高速	8,300	33,947.00	0.14
177	600416	湘电股份	4,700	33,793.00	0.14
178	300185	通裕重工	18,600	33,666.00	0.13
179	000400	许继电气	4,300	33,583.00	0.13
180	600761	安徽合力	3,680	33,414.40	0.13

181	002047	宝鹰股份	5,700	33,402.00	0.13
182	002212	南洋股份	2,800	33,292.00	0.13
183	300091	金通灵	2,400	33,120.00	0.13
184	600217	中再资环	5,400	33,102.00	0.13
185	002091	江苏国泰	5,200	33,020.00	0.13
186	002309	中利集团	2,300	32,890.00	0.13
187	600133	东湖高新	3,900	32,838.00	0.13
188	001965	招商公路	4,000	32,560.00	0.13
189	600545	卓郎智能	4,100	32,554.00	0.13
190	601908	京运通	7,100	32,518.00	0.13
191	601608	中信重工	12,371	32,164.60	0.13
192	002747	埃斯顿	2,300	32,154.00	0.13
193	000090	天健集团	5,160	31,992.00	0.13
194	603659	璞泰来	500	31,945.00	0.13
195	002617	露笑科技	3,900	31,785.00	0.13
196	600377	宁沪高速	3,500	31,780.00	0.13
197	002245	澳洋顺昌	4,900	31,703.00	0.13
198	600233	圆通速递	2,400	31,680.00	0.13
199	600546	山煤国际	7,100	31,666.00	0.13
200	000900	现代投资	7,600	31,616.00	0.13
201	002192	融捷股份	1,300	31,525.00	0.13
202	600317	营口港	13,800	31,188.00	0.12
203	002509	天广中茂	10,700	31,137.00	0.12
204	600611	大众交通	7,800	31,044.00	0.12
205	600312	平高电气	5,500	31,020.00	0.12
206	600491	龙元建设	4,400	30,756.00	0.12
207	000687	华讯方舟	3,300	30,393.00	0.12
208	002430	杭氧股份	2,100	30,093.00	0.12
209	601369	陕鼓动力	4,700	30,080.00	0.12
210	600169	太原重工	12,800	29,952.00	0.12
211	002073	软控股份	5,200	29,900.00	0.12
212	600114	东睦股份	3,060	29,896.20	0.12
213	600869	智慧能源	6,300	29,736.00	0.12
214	600033	福建高速	9,800	29,596.00	0.12
215	002097	山河智能	4,500	29,430.00	0.12
216	600502	安徽水利	7,320	29,426.40	0.12
217	000062	深圳华强	1,500	29,400.00	0.12
218	002061	浙江交科	2,800	29,316.00	0.12
219	002621	三垒股份	1,500	29,235.00	0.12
220	600151	航天机电	7,200	29,232.00	0.12
221	600326	西藏天路	4,900	28,959.00	0.12
222	600874	创业环保	3,100	28,954.00	0.12
223	600316	洪都航空	3,100	28,892.00	0.12
224	000967	盈峰环境	3,300	28,710.00	0.11

225	300177	中海达	2,200	28,600.00	0.11
226	603018	中设集团	1,800	28,512.00	0.11
227	300198	纳川股份	4,700	28,153.00	0.11
228	002717	岭南股份	2,860	28,056.60	0.11
229	300474	景嘉微	600	27,888.00	0.11
230	300495	美尚生态	2,400	27,840.00	0.11
231	600290	华仪电气	2,700	27,783.00	0.11
232	000711	京蓝科技	2,760	27,655.20	0.11
233	002480	新筑股份	3,600	27,432.00	0.11
234	601886	江河集团	3,300	27,159.00	0.11
235	600846	同济科技	3,600	27,108.00	0.11
236	000055	方大集团	4,800	26,976.00	0.11
237	603686	龙马环卫	1,100	26,884.00	0.11
238	600284	浦东建设	5,500	26,840.00	0.11
239	600496	精工钢构	9,000	26,820.00	0.11
240	600765	中航重机	3,600	26,784.00	0.11
241	000429	粤高速 A	3,700	26,714.00	0.11
242	002117	东港股份	1,800	26,694.00	0.11
243	600685	中船防务	2,000	26,680.00	0.11
244	600072	中船科技	2,900	26,564.00	0.11
245	002818	富森美	1,000	26,380.00	0.11
246	002320	海峡股份	1,390	26,340.50	0.11
247	600790	轻纺城	7,340	26,277.20	0.11
248	002482	广田集团	4,400	26,268.00	0.11
249	603588	高能环境	2,800	26,264.00	0.11
250	603338	浙江鼎力	560	25,984.00	0.10
251	002121	科陆电子	4,000	25,960.00	0.10
252	000061	农产品	4,800	25,920.00	0.10
253	600058	五矿发展	3,100	25,761.00	0.10
254	002276	万马股份	4,400	25,696.00	0.10
255	002531	天顺风能	5,900	25,665.00	0.10
256	300422	博世科	1,800	25,650.00	0.10
256	600512	腾达建设	11,400	25,650.00	0.10
257	002375	亚厦股份	4,800	25,632.00	0.10
258	000049	德赛电池	900	25,398.00	0.10
259	000951	中国重汽	1,900	25,251.00	0.10
260	002334	英威腾	4,300	25,155.00	0.10
261	002711	欧浦智网	3,000	25,140.00	0.10
262	002009	天奇股份	2,100	25,137.00	0.10
263	600805	悦达投资	4,900	24,990.00	0.10
264	002011	盾安环境	3,900	24,960.00	0.10
264	300280	南通锻压	800	24,960.00	0.10
265	603568	伟明环保	981	24,819.30	0.10
266	600343	航天动力	2,700	24,786.00	0.10

267	002163	中航三鑫	4,600	24,702.00	0.10
268	603308	应流股份	1,900	24,586.00	0.10
269	000680	山推股份	7,100	24,424.00	0.10
270	600093	易见股份	2,400	24,192.00	0.10
271	300457	赢合科技	1,050	24,160.50	0.10
272	600020	中原高速	6,400	24,128.00	0.10
273	300607	拓斯达	400	24,048.00	0.10
274	600619	海立股份	2,100	23,982.00	0.10
275	000976	华铁股份	4,600	23,966.00	0.10
276	000828	东莞控股	3,000	23,940.00	0.10
277	002564	天沃科技	4,200	23,730.00	0.09
278	002611	东方精工	3,840	23,692.80	0.09
279	603556	海兴电力	1,300	23,621.00	0.09
280	000666	经纬纺机	1,300	23,504.00	0.09
281	600880	博瑞传播	5,500	23,430.00	0.09
282	002459	天业通联	1,900	23,370.00	0.09
283	300111	向日葵	8,500	23,290.00	0.09
284	600391	航发科技	1,600	23,280.00	0.09
285	002622	融钰集团	4,800	23,232.00	0.09
286	300438	鹏辉能源	1,200	23,172.00	0.09
287	603699	纽威股份	1,600	23,168.00	0.09
288	300340	科恒股份	600	23,160.00	0.09
289	300284	苏交科	2,920	23,155.60	0.09
290	603111	康尼机电	3,500	23,135.00	0.09
291	603167	渤海轮渡	2,400	23,112.00	0.09
292	002586	围海股份	3,300	23,100.00	0.09
293	000652	泰达股份	7,400	23,088.00	0.09
294	600495	晋西车轴	6,000	23,040.00	0.09
295	603337	杰克股份	592	23,011.04	0.09
296	002663	普邦股份	7,700	22,869.00	0.09
297	002344	海宁皮城	4,700	22,842.00	0.09
298	000928	中钢国际	4,500	22,815.00	0.09
299	000820	神雾节能	2,700	22,734.00	0.09
300	300156	神雾环保	3,400	22,678.00	0.09
301	002523	天桥起重	7,076	22,572.44	0.09
302	600550	保变电气	5,500	22,385.00	0.09
303	002684	猛狮科技	1,900	22,382.00	0.09
304	002229	鸿博股份	2,500	22,250.00	0.09
305	002706	良信电器	3,400	22,236.00	0.09
306	002204	大连重工	5,500	22,110.00	0.09
307	000520	长航凤凰	7,200	22,032.00	0.09
308	002851	麦格米特	750	21,960.00	0.09
309	603056	德邦股份	800	21,912.00	0.09
310	000682	东方电子	5,700	21,888.00	0.09

311	600428	中远海特	6,100	21,655.00	0.09
312	002413	雷科防务	4,000	21,560.00	0.09
313	000903	云内动力	8,400	21,504.00	0.09
314	600180	瑞茂通	2,200	21,318.00	0.09
315	002833	弘亚数控	400	21,260.00	0.09
316	300388	国祯环保	1,100	21,197.00	0.08
317	000582	北部湾港	2,800	21,196.00	0.08
318	600382	广东明珠	2,000	21,100.00	0.08
319	603128	华贸物流	3,600	20,988.00	0.08
320	600677	航天通信	2,600	20,982.00	0.08
321	002307	北新路桥	3,780	20,865.60	0.08
322	002542	中化岩土	3,900	20,826.00	0.08
323	601002	晋亿实业	3,400	20,774.00	0.08
324	300506	名家汇	1,000	20,730.00	0.08
325	000777	中核科技	2,200	20,548.00	0.08
326	600405	动力源	4,000	20,480.00	0.08
327	300045	华力创通	2,202	20,412.54	0.08
328	600826	兰生股份	1,500	20,355.00	0.08
329	000806	银河生物	4,700	20,351.00	0.08
330	600783	鲁信创投	2,100	20,286.00	0.08
331	002367	康力电梯	3,400	20,264.00	0.08
332	600590	泰豪科技	3,120	20,124.00	0.08
333	600083	博信股份	1,000	19,970.00	0.08
334	300345	红宇新材	2,400	19,944.00	0.08
335	300424	航新科技	1,016	19,730.72	0.08
336	300008	天海防务	4,100	19,721.00	0.08
337	002325	洪涛股份	5,300	19,610.00	0.08
338	300187	永清环保	2,100	19,572.00	0.08
339	600984	建设机械	3,510	19,480.50	0.08
340	600350	山东高速	4,800	19,440.00	0.08
341	002527	新时达	2,700	19,413.00	0.08
342	002471	中超控股	6,300	19,404.00	0.08
343	002364	中恒电气	2,000	19,360.00	0.08
344	600939	重庆建工	3,900	19,266.00	0.08
345	600537	亿晶光电	5,900	19,234.00	0.08
346	002178	延华智能	3,000	19,200.00	0.08
347	300335	迪森股份	1,800	19,152.00	0.08
348	600784	鲁银投资	3,500	19,110.00	0.08
349	000099	中信海直	3,000	19,080.00	0.08
350	300116	坚瑞沃能	6,900	19,044.00	0.08
351	300201	海伦哲	4,200	18,942.00	0.08
352	002169	智光电气	4,200	18,900.00	0.08
353	600106	重庆路桥	6,290	18,870.00	0.08
354	002628	成都路桥	4,200	18,774.00	0.08

354	002751	易尚展示	600	18,774.00	0.08
355	300527	中国应急	1,860	18,711.60	0.07
356	002255	海陆重工	3,600	18,648.00	0.07
357	000544	中原环保	2,800	18,620.00	0.07
358	600184	光电股份	1,500	18,585.00	0.07
359	600798	宁波海运	5,100	18,564.00	0.07
360	600862	中航高科	3,000	18,450.00	0.07
361	603603	博天环境	900	18,441.00	0.07
362	600894	广日股份	3,100	18,383.00	0.07
363	600794	保税科技	6,100	18,361.00	0.07
364	002775	文科园林	1,390	18,320.20	0.07
365	300123	亚光科技	1,600	18,304.00	0.07
366	002342	巨力索具	4,800	18,192.00	0.07
367	603979	金诚信	2,130	18,168.90	0.07
368	002685	华东重机	2,200	18,106.00	0.07
369	002479	富春环保	3,200	18,080.00	0.07
370	002335	科华恒盛	1,000	18,050.00	0.07
371	600626	申达股份	3,500	18,025.00	0.07
372	600662	强生控股	4,500	17,955.00	0.07
373	601126	四方股份	3,500	17,815.00	0.07
374	000005	世纪星源	6,000	17,760.00	0.07
374	600517	置信电气	4,800	17,760.00	0.07
375	601890	亚星锚链	4,100	17,753.00	0.07
376	600481	双良节能	5,800	17,748.00	0.07
377	300097	智云股份	1,000	17,720.00	0.07
378	603638	艾迪精密	692	17,694.44	0.07
379	600855	航天长峰	1,500	17,610.00	0.07
380	002060	粤水电	6,000	17,580.00	0.07
381	000821	京山轻机	1,900	17,499.00	0.07
382	002541	鸿路钢构	2,250	17,460.00	0.07
383	300393	中来股份	600	17,448.00	0.07
384	002738	中矿资源	800	17,384.00	0.07
385	300477	合纵科技	900	17,352.00	0.07
386	000837	秦川机床	3,500	17,325.00	0.07
386	002333	罗普斯金	1,100	17,325.00	0.07
387	002698	博实股份	1,900	17,252.00	0.07
388	300278	华昌达	1,900	17,233.00	0.07
389	300048	合康新能	5,600	17,192.00	0.07
390	300228	富瑞特装	3,000	17,190.00	0.07
391	300510	金冠电气	700	17,136.00	0.07
392	002526	山东矿机	5,240	17,030.00	0.07
393	002518	科士达	1,700	16,949.00	0.07
394	000018	神州长城	5,100	16,932.00	0.07
395	002196	方正电机	2,300	16,905.00	0.07

396	300034	钢研高纳	1,800	16,848.00	0.07
397	002141	贤丰控股	4,000	16,760.00	0.07
398	300193	佳士科技	2,900	16,733.00	0.07
399	002545	东方铁塔	2,800	16,660.00	0.07
400	601326	秦港股份	4,100	16,646.00	0.07
401	002374	丽鹏股份	3,400	16,558.00	0.07
402	600897	厦门空港	800	16,496.00	0.07
403	002322	理工环科	1,300	16,471.00	0.07
404	000065	北方国际	2,150	16,469.00	0.07
405	600292	远达环保	2,800	16,436.00	0.07
406	603117	万林股份	2,300	16,284.00	0.07
407	002298	中电鑫龙	2,300	16,238.00	0.06
408	002218	拓日新能	5,300	16,218.00	0.06
409	300400	劲拓股份	1,200	16,212.00	0.06
410	002339	积成电子	2,200	16,170.00	0.06
411	600973	宝胜股份	4,400	16,060.00	0.06
412	603843	正平股份	1,400	16,044.00	0.06
413	600468	百利电气	2,900	16,037.00	0.06
414	000010	美丽生态	4,100	16,031.00	0.06
415	603806	福斯特	727	16,001.27	0.06
416	603298	杭叉集团	1,300	15,977.00	0.06
417	600375	华菱星马	3,200	15,904.00	0.06
418	603466	风语筑	600	15,750.00	0.06
419	600548	深高速	2,000	15,700.00	0.06
420	600207	安彩高科	2,366	15,686.58	0.06
421	300190	维尔利	2,860	15,587.00	0.06
422	603359	东珠生态	720	15,566.40	0.06
423	002556	辉隆股份	3,100	15,500.00	0.06
424	002850	科达利	550	15,488.00	0.06
425	002639	雪人股份	2,400	15,456.00	0.06
426	600836	界龙实业	3,800	15,390.00	0.06
427	002652	扬子新材	2,400	15,384.00	0.06
428	002135	东南网架	3,000	15,210.00	0.06
429	300035	中科电气	2,800	15,176.00	0.06
430	601789	宁波建工	4,200	15,162.00	0.06
431	000404	华意压缩	3,500	15,155.00	0.06
432	300600	瑞特股份	400	15,152.00	0.06
433	600035	楚天高速	4,900	15,092.00	0.06
434	002769	普路通	1,200	15,048.00	0.06
435	603959	百利科技	840	15,027.60	0.06
436	000905	厦门港务	1,900	14,953.00	0.06
437	002691	冀凯股份	1,190	14,839.30	0.06
438	000812	陕西金叶	4,000	14,800.00	0.06
438	300215	电科院	2,500	14,800.00	0.06

439	300013	新宁物流	1,500	14,790.00	0.06
440	603618	杭电股份	2,400	14,784.00	0.06
441	603085	天成自控	600	14,772.00	0.06
442	000925	众合科技	2,380	14,756.00	0.06
443	600650	锦江投资	1,400	14,672.00	0.06
444	601008	连云港	4,300	14,620.00	0.06
445	603648	畅联股份	800	14,496.00	0.06
446	600368	五洲交通	4,520	14,464.00	0.06
447	002090	金智科技	1,000	14,460.00	0.06
448	002441	众业达	1,900	14,440.00	0.06
449	002713	东易日盛	700	14,385.00	0.06
450	300444	双杰电气	945	14,345.10	0.06
451	002529	海源机械	1,300	14,313.00	0.06
452	600012	皖通高速	2,400	14,304.00	0.06
453	000151	中成股份	1,200	14,292.00	0.06
454	000856	冀东装备	1,100	14,124.00	0.06
455	300307	慈星股份	2,300	14,099.00	0.06
456	600830	香溢融通	2,600	14,092.00	0.06
457	603126	中材节能	2,200	13,970.00	0.06
458	603357	设计总院	700	13,888.00	0.06
459	000701	厦门信达	2,000	13,880.00	0.06
460	002164	宁波东力	2,400	13,872.00	0.06
461	600313	农发种业	4,600	13,846.00	0.06
462	601700	风范股份	4,000	13,840.00	0.06
463	000498	山东路桥	3,200	13,632.00	0.05
464	002533	金杯电工	2,800	13,580.00	0.05
465	002457	青龙管业	1,700	13,566.00	0.05
466	603169	兰石重装	2,700	13,527.00	0.05
467	000557	西部创业	4,200	13,524.00	0.05
467	600526	菲达环保	2,300	13,524.00	0.05
468	603698	航天工程	900	13,482.00	0.05
469	002158	汉钟精机	1,500	13,470.00	0.05
470	002111	威海广泰	1,300	13,468.00	0.05
471	600501	航天晨光	1,800	13,446.00	0.05
472	002546	新联电子	3,600	13,428.00	0.05
472	300195	长荣股份	1,200	13,428.00	0.05
473	600279	重庆港九	3,000	13,320.00	0.05
474	000811	冰轮环境	2,800	13,300.00	0.05
475	300664	鹏鹞环保	700	13,265.00	0.05
476	000885	同力水泥	1,300	13,208.00	0.05
477	300441	鲍斯股份	1,420	13,206.00	0.05
478	603728	鸣志电器	840	13,196.40	0.05
479	002682	龙洲股份	1,600	13,168.00	0.05
480	300263	隆华节能	2,500	13,100.00	0.05

481	603030	全筑股份	1,900	13,091.00	0.05
482	300161	华中数控	1,000	13,090.00	0.05
483	002350	北京科锐	2,110	13,082.00	0.05
484	002689	远大智能	3,400	13,056.00	0.05
485	300415	伊之密	1,400	13,048.00	0.05
486	300427	红相股份	900	12,960.00	0.05
487	600475	华光股份	1,200	12,828.00	0.05
488	603458	勘设股份	300	12,807.00	0.05
489	002535	林州重机	3,400	12,784.00	0.05
490	300011	鼎汉技术	2,000	12,760.00	0.05
491	002781	奇信股份	800	12,640.00	0.05
492	000906	浙商中拓	2,458	12,634.12	0.05
493	002006	精功科技	2,300	12,627.00	0.05
494	000533	万家乐	3,400	12,546.00	0.05
495	000068	华控赛格	4,100	12,464.00	0.05
496	603616	韩建河山	1,000	12,390.00	0.05
497	300172	中电环保	2,200	12,386.00	0.05
498	300249	依米康	1,900	12,312.00	0.05
499	600592	龙溪股份	2,000	12,300.00	0.05
500	002795	永和智控	600	12,282.00	0.05
501	002733	雄韬股份	1,200	12,276.00	0.05
502	600119	长江投资	1,500	12,270.00	0.05
503	002829	星网宇达	400	12,236.00	0.05
504	002282	博深工具	1,200	12,192.00	0.05
505	300276	三丰智能	1,000	12,180.00	0.05
506	300262	巴安水务	2,350	12,173.00	0.05
507	300018	中元股份	2,400	12,168.00	0.05
507	300171	东富龙	1,800	12,168.00	0.05
508	600739	辽宁成大	800	12,144.00	0.05
509	603960	克来机电	400	12,116.00	0.05
510	002140	东华科技	1,600	12,112.00	0.05
511	603333	明星电缆	2,000	12,040.00	0.05
512	002743	富煌钢构	1,700	12,036.00	0.05
513	603776	永安行	300	12,012.00	0.05
514	603929	亚翔集成	600	11,988.00	0.05
515	002451	摩恩电气	1,200	11,952.00	0.05
516	600190	锦州港	3,800	11,894.00	0.05
517	002889	东方嘉盛	300	11,790.00	0.05
518	002346	柘中股份	900	11,646.00	0.05
519	000530	大冷股份	3,100	11,625.00	0.05
520	300362	天翔环境	1,200	11,616.00	0.05
521	000551	创元科技	2,000	11,580.00	0.05
522	603318	派思股份	900	11,367.00	0.05
523	002357	富临运业	1,200	11,364.00	0.05

524	600262	北方股份	600	11,340.00	0.05
525	000619	海螺型材	1,800	11,322.00	0.05
526	002122	*ST 天马	5,600	11,312.00	0.05
527	603007	花王股份	1,000	11,260.00	0.05
528	002620	瑞和股份	1,550	11,253.00	0.04
529	002887	绿茵生态	400	11,040.00	0.04
530	300490	华自科技	600	11,028.00	0.04
531	002903	宇环数控	300	11,025.00	0.04
532	002026	山东威达	1,800	11,016.00	0.04
533	603300	华铁科技	2,100	10,941.00	0.04
534	603016	新宏泰	500	10,920.00	0.04
535	600843	上工申贝	1,300	10,907.00	0.04
536	002116	中国海诚	1,500	10,860.00	0.04
537	002534	杭锅股份	1,600	10,832.00	0.04
538	002651	利君股份	2,100	10,815.00	0.04
539	000058	深赛格	2,100	10,752.00	0.04
540	002184	海得控制	900	10,746.00	0.04
541	300425	环能科技	2,336	10,745.60	0.04
542	600629	华建集团	900	10,737.00	0.04
543	002694	顾地科技	2,100	10,668.00	0.04
544	002918	蒙娜丽莎	450	10,647.00	0.04
544	600113	浙江东日	1,300	10,647.00	0.04
545	002452	长高集团	2,600	10,582.00	0.04
546	000548	湖南投资	2,400	10,512.00	0.04
547	600278	东方创业	1,330	10,493.70	0.04
548	300151	昌红科技	1,800	10,458.00	0.04
549	002789	建艺集团	300	10,410.00	0.04
550	002300	太阳电缆	1,900	10,374.00	0.04
551	300447	全信股份	800	10,352.00	0.04
552	600841	上柴股份	1,100	10,329.00	0.04
553	002623	亚玛顿	600	10,284.00	0.04
554	002671	龙泉股份	2,300	10,258.00	0.04
555	600192	长城电工	2,200	10,252.00	0.04
556	300491	通合科技	500	10,250.00	0.04
557	603058	永吉股份	900	10,242.00	0.04
558	002896	中大力德	200	10,202.00	0.04
559	603032	德新交运	720	10,166.40	0.04
560	002046	轴研科技	1,500	10,155.00	0.04
561	300152	科融环境	3,500	10,150.00	0.04
562	300512	中亚股份	600	10,146.00	0.04
563	600853	龙建股份	2,800	10,136.00	0.04
564	300140	中环装备	1,200	10,044.00	0.04
565	603339	四方冷链	500	9,920.00	0.04
566	002040	南京港	1,100	9,900.00	0.04

567	300500	启迪设计	400	9,872.00	0.04
568	002606	大连电瓷	2,000	9,800.00	0.04
568	300004	南风股份	2,500	9,800.00	0.04
568	300117	嘉寓股份	2,500	9,800.00	0.04
569	002162	悦心健康	3,100	9,734.00	0.04
570	300693	盛弘股份	300	9,690.00	0.04
571	300696	爱乐达	300	9,687.00	0.04
572	600268	国电南自	2,300	9,683.00	0.04
573	002823	凯中精密	741	9,662.64	0.04
574	300461	田中精机	360	9,500.40	0.04
575	600822	上海物贸	1,100	9,493.00	0.04
576	002692	睿康股份	2,500	9,450.00	0.04
577	300486	东杰智能	600	9,366.00	0.04
578	603203	快克股份	416	9,297.60	0.04
579	300545	联得装备	400	9,268.00	0.04
580	300675	建科院	300	9,243.00	0.04
581	300153	科泰电源	1,100	9,196.00	0.04
582	002884	凌霄泵业	200	9,188.00	0.04
583	603895	天永智能	280	9,175.60	0.04
584	603778	乾景园林	1,800	9,162.00	0.04
585	603690	至纯科技	500	9,145.00	0.04
586	300471	厚普股份	1,300	9,113.00	0.04
587	300466	赛摩电气	1,200	9,096.00	0.04
588	002757	南兴装备	300	9,084.00	0.04
589	601038	一拖股份	1,700	8,993.00	0.04
590	300334	津膜科技	1,100	8,954.00	0.04
591	603535	嘉诚国际	300	8,919.00	0.04
592	300649	杭州园林	300	8,853.00	0.04
593	300484	蓝海华腾	600	8,838.00	0.04
594	300040	九洲电气	1,500	8,805.00	0.04
595	603098	森特股份	720	8,798.40	0.04
596	300407	凯发电气	1,200	8,796.00	0.04
597	600152	维科技术	1,600	8,720.00	0.03
598	603015	弘讯科技	1,200	8,676.00	0.03
599	300662	科锐国际	400	8,648.00	0.03
600	603789	星光农机	700	8,638.00	0.03
601	002822	中装建设	1,500	8,625.00	0.03
602	300420	五洋停车	1,960	8,604.40	0.03
603	603329	上海雅仕	300	8,574.00	0.03
604	603569	长久物流	600	8,568.00	0.03
605	300503	昊志机电	700	8,561.00	0.03
606	603011	合锻智能	1,600	8,560.00	0.03
607	300056	三维丝	1,400	8,554.00	0.03
608	002791	坚朗五金	700	8,533.00	0.03

609	300412	迦南科技	900	8,523.00	0.03
610	300726	宏达电子	300	8,520.00	0.03
611	000626	远大控股	1,200	8,448.00	0.03
612	603283	赛腾股份	300	8,433.00	0.03
613	300414	中光防雷	500	8,410.00	0.03
614	603903	中持股份	300	8,394.00	0.03
615	603069	海汽集团	900	8,388.00	0.03
616	300443	金雷风电	800	8,376.00	0.03
617	300069	金利华电	700	8,358.00	0.03
618	603060	国检集团	500	8,345.00	0.03
619	002323	雅百特	1,600	8,128.00	0.03
620	601882	海天精工	700	8,092.00	0.03
621	603717	天域生态	760	8,086.40	0.03
622	002837	英维克	500	8,005.00	0.03
623	002877	智能自控	400	7,996.00	0.03
624	603607	京华激光	300	7,950.00	0.03
625	002793	东音股份	600	7,944.00	0.03
626	603912	佳力图	500	7,940.00	0.03
627	300719	安达维尔	500	7,935.00	0.03
628	300430	诚益通	800	7,928.00	0.03
629	300374	恒通科技	710	7,831.30	0.03
630	603066	音飞储存	834	7,822.92	0.03
631	603757	大元泵业	280	7,814.80	0.03
632	603311	金海环境	700	7,812.00	0.03
633	002645	华宏科技	680	7,792.80	0.03
634	603416	信捷电气	300	7,779.00	0.03
635	300718	长盛轴承	400	7,688.00	0.03
636	300103	达刚路机	950	7,619.00	0.03
637	300713	英可瑞	180	7,597.80	0.03
638	300668	杰恩设计	250	7,525.00	0.03
639	002227	奥特迅	600	7,506.00	0.03
640	300569	天能重工	500	7,500.00	0.03
641	603218	日月股份	400	7,492.00	0.03
641	603937	丽岛新材	400	7,492.00	0.03
642	603315	福鞍股份	600	7,464.00	0.03
643	300385	雪浪环境	400	7,440.00	0.03
644	603628	清源股份	700	7,413.00	0.03
645	603797	联泰环保	500	7,355.00	0.03
646	002879	长缆科技	420	7,333.20	0.03
647	603656	泰禾光电	420	7,320.60	0.03
648	002922	伊戈尔	300	7,230.00	0.03
649	300141	和顺电气	900	7,227.00	0.03
650	002532	新界泵业	1,500	7,140.00	0.03
651	603507	振江股份	300	7,104.00	0.03

652	002882	金龙羽	600	7,080.00	0.03
653	300692	中环环保	300	7,074.00	0.03
654	603289	泰瑞机器	600	7,056.00	0.03
655	300554	三超新材	200	7,048.00	0.03
656	002730	电光科技	900	6,993.00	0.03
657	603388	元成股份	500	6,985.00	0.03
658	603861	白云电器	600	6,978.00	0.03
659	300619	金银河	200	6,940.00	0.03
660	002560	通达股份	1,500	6,810.00	0.03
661	603855	华荣股份	700	6,797.00	0.03
662	000509	华塑控股	2,400	6,792.00	0.03
663	603177	德创环保	500	6,780.00	0.03
664	603396	金辰股份	200	6,750.00	0.03
665	603577	汇金通	600	6,720.00	0.03
666	300629	新劲刚	300	6,675.00	0.03
667	300711	广哈通信	300	6,630.00	0.03
668	603321	梅轮电梯	700	6,615.00	0.03
669	002785	万里石	700	6,608.00	0.03
670	603183	建研院	300	6,603.00	0.03
671	002774	快意电梯	700	6,587.00	0.03
672	600463	空港股份	900	6,579.00	0.03
673	603527	众源新材	400	6,556.00	0.03
674	603909	合诚股份	200	6,404.00	0.03
675	300216	千山药机	1,200	6,372.00	0.03
676	300688	创业黑马	100	6,371.00	0.03
677	603200	上海洗霸	200	6,368.00	0.03
678	300617	安靠智电	250	6,360.00	0.03
679	603970	中农立华	340	6,351.20	0.03
680	603500	祥和实业	420	6,333.60	0.03
681	002892	科力尔	200	6,328.00	0.03
682	603356	华菱精工	300	6,294.00	0.03
683	002786	银宝山新	1,000	6,200.00	0.02
684	603131	上海沪工	400	6,128.00	0.02
685	002811	亚泰国际	400	6,036.00	0.02
686	300210	森远股份	1,400	6,020.00	0.02
687	300697	电工合金	390	5,967.00	0.02
688	300712	永福股份	300	5,958.00	0.02
689	002843	泰嘉股份	400	5,948.00	0.02
690	300475	聚隆科技	600	5,838.00	0.02
691	002801	微光股份	220	5,821.20	0.02
692	300581	晨曦航空	380	5,631.60	0.02
693	300549	优德精密	300	5,352.00	0.02
694	603955	大千生态	260	5,285.80	0.02
695	603859	能科股份	300	5,175.00	0.02

696	300690	双一科技	200	5,156.00	0.02
697	603985	恒润股份	260	5,064.80	0.02
698	603637	镇海股份	390	5,046.60	0.02
699	603966	法兰泰克	520	5,033.60	0.02
700	300402	宝色股份	500	4,965.00	0.02
701	300234	开尔新材	800	4,944.00	0.02
702	603320	迪贝电气	200	4,582.00	0.02
703	002836	新宏泽	300	4,572.00	0.02
704	603063	禾望电气	400	4,524.00	0.02
705	603988	中电电机	320	4,384.00	0.02
706	002860	星帅尔	200	4,172.00	0.02
707	603050	科林电气	300	4,116.00	0.02
708	603316	诚邦股份	400	3,916.00	0.02
709	603488	展鹏科技	400	3,668.00	0.01
710	603088	宁波精达	280	3,651.20	0.01

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	600760	中航沈飞	113,055.00	0.32
2	002129	中环股份	106,656.00	0.30
3	601877	正泰电器	66,794.00	0.19
4	603899	晨光文具	66,261.00	0.18
5	002168	深圳惠程	58,000.00	0.16
6	000697	炼石有色	57,366.00	0.16
7	601228	广州港	45,752.00	0.13
8	601567	三星医疗	42,847.00	0.12
9	601828	美凯龙	40,635.00	0.11
10	601100	恒立液压	40,295.00	0.11
11	002389	南洋科技	39,952.00	0.11
12	600478	科力远	39,699.00	0.11
13	002595	豪迈科技	36,787.00	0.10
14	601111	中国国航	34,968.00	0.10
15	001965	招商公路	33,600.00	0.09
16	600377	宁沪高速	33,397.00	0.09
17	603699	纽威股份	32,750.00	0.09
18	601369	陕鼓动力	31,745.00	0.09
19	603659	璞泰来	31,556.00	0.09

20	002061	浙江交科	30,798.00	0.09
----	--------	------	-----------	------

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，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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	002384	东山精密	108,024.00	0.30
2	601989	中国重工	82,822.00	0.23
3	600150	*ST 船舶	67,744.00	0.19
4	300750	宁德时代	65,500.00	0.18
5	300308	中际旭创	60,795.00	0.17
6	601668	中国建筑	51,156.00	0.14
7	002547	春兴精工	36,319.00	0.10
8	002659	凯文教育	34,368.00	0.10
9	600009	上海机场	28,049.83	0.08
10	600620	天宸股份	27,768.00	0.08
11	002247	帝龙文化	27,344.00	0.08
12	601766	中国中车	26,130.00	0.07
13	601138	工业富联	24,910.00	0.07
14	601006	大秦铁路	24,494.00	0.07
15	000881	中广核技	22,706.00	0.06
16	300230	永利股份	22,617.60	0.06
17	000923	河北宣工	21,901.00	0.06
18	300384	三联虹普	21,378.00	0.06
19	002559	亚威股份	21,185.00	0.06
20	000338	潍柴动力	20,615.00	0.06

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	2,441,646.34
卖出股票收入（成交）总额	3,134,654.94

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票未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	324.46

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	420.57

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	601390	中国中铁	315,234.00	1.26	重大事项停 牌
2	600221	海航控股	314,925.00	1.26	重大事项停 牌

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
631	52,561.68	15,309,137.00	46.16%	17,857,284.00	53.84%

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	赵翔	2,999,174.00	9.04%
2	上海惠澄资产管理有限公司—惠澄伯年一号私募证券投资基金	2,000,000.00	6.03%
3	何朗	634,452.00	1.91%
4	罗玉嫦	500,009.00	1.51%
5	陈茂雄	499,215.00	1.51%
6	欧阳珮	409,400.00	1.23%
7	陈丽红	397,000.00	1.20%
8	张小宁	200,046.00	0.60%
9	兰旭东	200,015.00	0.60%
10	邓燕姝	200,015.00	0.60%
11	方心愉	200,015.00	0.60%
12	广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	13,292,509.00	40.08%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年6月13日）基金份额总额	291,166,421.00
本报告期期初基金份额总额	37,166,421.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,166,421.00

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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和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	
海通证券	2	2,914,992.96	52.71%	2,132.04	46.67%	-
广发证券	3	2,615,715.22	47.29%	2,436.18	53.33%	-
山西证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

天风证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

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。

10.8 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	关于广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22

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
广发中证全指工业交易型开	1	20180101-20180630	16,490,509.00	0.00	3,198,000.00	13,292,509.00	40.08%

放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 发 起 式 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书

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：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，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

二〇一八年八月二十四日