

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

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 审计报告.....	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68

8.6	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 .....	68
8.7	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 .....	68
8.8	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 .....	68
8.9	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 .....	68
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	69
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.12	投资组合报告附注 .....	69
§9	基金份额持有人信息 .....	70
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	70
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	71
§10	开放式基金份额变动 .....	71
§11	重大事件揭示 .....	71
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	71
11.2	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 .....	71
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4	基金投资策略的改变 .....	72
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8	其他重大事件 .....	73
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
12.1	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 .....	73
§13	备查文件目录 .....	73
13.1	备查文件目录 .....	74
13.2	存放地点 .....	74
13.3	查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF
基金主代码	512100
交易代码	512100
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	227,892,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上交所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 1000 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201

注册地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商 银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商 银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	张海波	李建红

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企 业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年 9 月 29 日 (基金合同生效 日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-26,401,162.54	-10,105,676.50	3,303,904.56
本期利润	-42,998,159.44	-13,394,749.96	-5,729,509.63
加权平均基金份额本期利润	-0.2813	-0.1030	-0.0172
本期加权平均净值利润率	-42.37%	-11.56%	-1.73%
本期基金份额净值增长率	-35.49%	-13.08%	-5.41%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-107,027,026.41	-21,847,640.83	-9,083,512.67
期末可供分配基金份额利润	-0.4696	-0.1778	-0.0541
期末基金资产净值	120,864,973.59	101,044,359.17	158,808,487.33
期末基金份额净值	0.5304	0.8222	0.9459
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-46.96%	-17.78%	-5.41%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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。

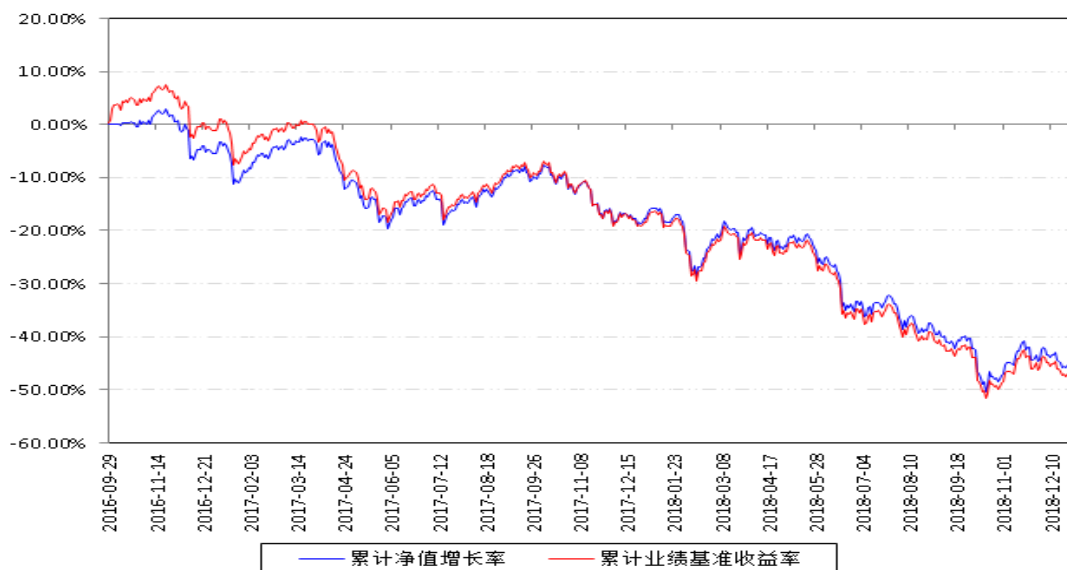
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	-11.17%	1.89%	-11.17%	1.90%	0.00%	-0.01%
过去六个月	-20.53%	1.61%	-21.01%	1.62%	0.48%	-0.01%
过去一年	-35.49%	1.55%	-36.87%	1.56%	1.38%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-46.96%	1.27%	-48.44%	1.29%	1.48%	-0.02%

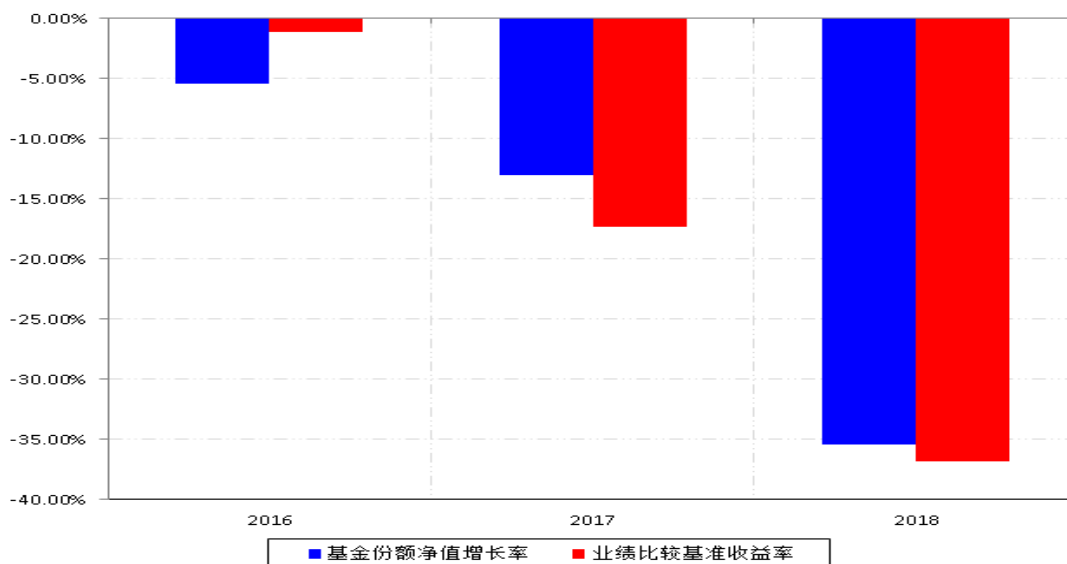
### 3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证1000ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2016 年 9 月 29 日成立，成立当年净值增长率按当年实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2016 年 9 月 29 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模近 8,300 亿元，旗下管理 178 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周豪	本基金基金经理	2016 年 9 月 29 日	-	10 年	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任数量化投资部高级研究员；2018 年 2 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；2016 年 4 月至今，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至今，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至今，任 1000ETF 基金经理；2017 年 8 月至今，任南方有色金属基金经理；2017 年 9 月至今，任南方有色金属联接基金经理；2018 年 1 月至今，任南方中证 100 基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为7次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内中证 1000 指数下跌 36.87%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。

(3) 根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.5304 元，报告期内，份额净值增长率为-35.49%，同期业绩基准增长率为-36.87%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，在去杠杆、防风险大背景下，经济下行压力较大，同时外部受中美贸易冲突加剧影响，A 股市场整体表现不佳，主要股指均大幅回落。展望 2019 年，仍需重点关注经济下行情况，另一方面，当前 A 股估值整体处于历史低位，如外部环境好转，预计会有较好表现，建议关注其中长期配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，并积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、加大合规问责力度，强化全员合规、主动合规理念；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；积极参与新产品、新业务合规评估工作，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；继续按照风险为本的原则积极开展各项反洗钱工作，进一步升级反洗钱业务系统，优化其他反洗钱资源配置，重点推进《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》的具体落实工作，加强业务部门反洗钱风险评估频率，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监控、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红方式；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 23058 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容我们审计了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证 1000ETF”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表, 2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方中证 1000ETF 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方中证 1000ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	南方中证 1000ETF 的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方中证 1000ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方中证 1000ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督南方中证 1000ETF 的财务报告过程。
注册会计师对财务报	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的

表审计的责任	<p>重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方中证 1000ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 1000ETF 不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞 曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
----	-----	----------------------	-----------------------

资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,384,754.79	1,897,658.96
结算备付金		900,709.02	930,130.62
存出保证金		268,822.89	505,212.60
交易性金融资产	7.4.7.2	119,054,439.19	98,025,108.84
其中：股票投资		119,054,439.19	97,967,998.40
基金投资		-	-
债券投资		-	57,110.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	904.19	949.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		122,609,630.08	101,359,060.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,005,902.86	291.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,691.48	40,949.71
应付托管费		10,738.31	8,189.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	14,206.63	5,298.80
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	660,117.21	259,971.59
负债合计		1,744,656.49	314,701.77
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	227,892,000.00	122,892,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-107,027,026.41	-21,847,640.83
所有者权益合计		120,864,973.59	101,044,359.17
负债和所有者权益总计		122,609,630.08	101,359,060.94

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5304 元，基金份额总额 227,892,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-41,699,216.36	-12,038,229.04
1. 利息收入		31,363.99	33,058.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	31,285.16	33,003.44
债券利息收入		78.83	55.31
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）		-25,277,033.14	-8,899,045.21
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-25,504,380.02	-9,690,081.53
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-3,301.56	10,373.85
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.4	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-641,000.00	204,400.00
股利收益	7.4.7.16	871,648.44	576,262.47
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,596,996.90	-3,289,073.46
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.18	143,449.69	116,830.88
减：二、费用		1,298,943.08	1,356,520.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	505,907.42	582,446.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	101,181.48	116,489.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	144,822.93	165,516.64
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	7.4.7.20	547,031.25	492,068.77
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-42,998,159.44	-13,394,749.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-42,998,159.44	-13,394,749.96

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
----	--------------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	122,892,000.00	-21,847,640.83	101,044,359.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,998,159.44	-42,998,159.44
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)	105,000,000.00	-42,181,226.14	62,818,773.86
其中: 1. 基金申购款	258,000,000.00	-99,011,067.35	158,988,932.65
2. 基金赎回款	-153,000,000.00	56,829,841.21	-96,170,158.79
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)	227,892,000.00	-107,027,026.41	120,864,973.59
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	167,892,000.00	-9,083,512.67	158,808,487.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,394,749.96	-13,394,749.96
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)	-45,000,000.00	630,621.80	-44,369,378.20
其中: 1. 基金申购款	93,000,000.00	-11,750,721.55	81,249,278.45
2. 基金赎回款	-138,000,000.00	12,381,343.35	-125,618,656.65
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）	122,892,000.00	-21,847,640.83	101,044,359.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]366 号《关于准予南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 587,892,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 587,892,000.00 份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]264 号审核同意,本基金 587,892,000.00 份基金份额于 2016 年 11 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 1000 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以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)。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。在正常市

场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。  
本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、



财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	2,384,754.79	1,897,658.96
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	2,384,754.79	1,897,658.96

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	147,952,803.74	119,054,439.19	-28,898,364.55
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	147,952,803.74	119,054,439.19	-28,898,364.55
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	110,326,836.49	97,967,998.40	-12,358,838.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	59,000.00	57,110.44
	银行间市场	-	-
	合计	59,000.00	57,110.44
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	110,385,836.49	98,025,108.84	-12,360,727.65

于 2018 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零(2017 年 12 月 31 日：同)。

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
----	----------------------

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,634,160.00	-	-	-
一股指期货	1,634,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,634,160.00	-	-	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,415,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,415,600.00	-	-	-

衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1906	IC1906	2	1,613,040.00	-21,120.00
	减：可抵销期货暂收款			-21,120.00
	股指期货投资净额			

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	391.06	383.04

应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	499.82	547.54
应收债券利息	-	12.19
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	13.31	7.15
合计	904.19	949.92

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	14,206.63	5,298.80
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	14,206.63	5,298.80

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付赎回费	-	-
应退替代款	324,935.21	5,571.79
预提费用	284,000.00	164,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退替代款	1,182.00	40,399.80
应付替代款	-	-
其他	-	-
合计	660,117.21	259,971.59

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

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

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日
----	-------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,892,000.00	122,892,000.00
本期申购	258,000,000.00	258,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-153,000,000.00	-153,000,000.00
本期末	227,892,000.00	227,892,000.00

#### 7.4.7.10 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	-8,222,345.32	-13,625,295.51	-21,847,640.83
本期利润	-26,401,162.54	-16,596,996.90	-42,998,159.44
本期基金份额交易产生的变动数	-14,091,171.21	-28,090,054.93	-42,181,226.14
其中：基金申购款	-36,372,483.77	-62,638,583.58	-99,011,067.35
基金赎回款	22,281,312.56	34,548,528.65	56,829,841.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48,714,679.07	-58,312,347.34	-107,027,026.41

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,732.46	15,906.03
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,318.57	15,220.53
其他	234.13	1,876.88
合计	31,285.16	33,003.44

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,321,286.33	-7,945,323.24
股票投资收益——赎回差价收入	-6,183,093.69	-1,744,758.29
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-25,504,380.02	-9,690,081.53

##### 7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	98,793,443.33	124,512,666.84
减：卖出股票成本总额	118,114,729.66	132,457,990.08
买卖股票差价收入	-19,321,286.33	-7,945,323.24

**7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	96,170,158.79	125,618,656.65
减：现金支付赎回款总额	64,011,310.79	87,368,046.65
减：赎回股票成本总额	38,341,941.69	39,995,368.29
赎回差价收入	-6,183,093.69	-1,744,758.29

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	105,389.46	81,216.97
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	108,600.00	70,800.00
减：应收利息总额	91.02	43.12
买卖债券差价收入	-3,301.56	10,373.85

**7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-641,000.00	204,400.00
合计	-641,000.00	204,400.00

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	871,648.44	576,262.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	871,648.44	576,262.47

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-16,537,636.90	-3,327,313.46
——股票投资	-16,539,526.46	-3,325,423.90
——债券投资	1,889.56	-1,889.56
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-59,360.00	38,240.00
——权证投资	-	-
期货	-	38,240.00
——期货投资	-59,360.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-16,596,996.90	-3,289,073.46

本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益为零(2017 度：同)。

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
替代损益	143,449.69	116,830.88
合计	143,449.69	116,830.88

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

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2017 年 1
----	--------------------	------------------

	2018 年 12 月 31 日	月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	144,822.93	165,516.64
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	144,822.93	165,516.64

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	54,000.00	54,000.00
信息披露费	230,000.00	110,000.00
指数使用费	200,000.00	224,478.56
银行费用	3,031.25	3,590.21
上市费	60,000.00	100,000.00
合计	547,031.25	492,068.77

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司



1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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
华泰证券	68,464,994.17	28.23%	61,548,581.69	28.60%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 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 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	6,848.09	28.23%	3,975.62	27.98%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	6,155.27	28.59%	2,417.81	45.63%

1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管	505,907.42	582,446.28

理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	101,181.48	116,489.23

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

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.3 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,384,754.79	16,732.46	1,897,658.96	15,906.03

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

##### 7.4.10.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 7.4.12.2 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
002680	*ST 长生	2018 年 11 月 19 日	重大事项停牌	3.94	2019 年 1 月 16 日	3.74	22,100	243,516.49	87,074.00	-

本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 1000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资 (2017 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.06%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.07%。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	2,384,754.79	-	-	-	2,384,754.79
结算备付金	900,709.02	-	-	-	900,709.02
存出保证金	26,866.89	-	-	241,956.00	268,822.89
交易性金融资产	-	-	-	119,054,439.19	119,054,439.19
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	904.19	904.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,312,330.70	-	-	119,297,299.38	122,609,630.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	53,691.48	53,691.48
应付托管费	-	-	-	10,738.31	10,738.31
应付证券清算款	-	-	-	1,005,902.86	1,005,902.86
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	14,206.63	14,206.63
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	660,117.21	660,117.21
负债总计	-	-	-	1,744,656.49	1,744,656.49
利率敏感度缺口	3,312,330.70	-	-	117,552,642.89	120,864,973.59
上年度末 2017 年 12	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

月 31 日					
资产					
银行存款	1,897,658.96	-	-	-	1,897,658.96
结算备付金	930,130.62	-	-	-	930,130.62
存出保证金	14,444.60	-	-	490,768.00	505,212.60
交易性金融资产	-	-	57,110.44	97,967,998.40	98,025,108.84
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	949.92	949.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,842,234.18	-	57,110.44	98,459,716.32	101,359,060.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	40,949.71	40,949.71
应付托管费	-	-	-	8,189.96	8,189.96
应付证券清算款	-	-	-	291.71	291.71
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,298.80	5,298.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	259,971.59	259,971.59
负债总计	-	-	-	314,701.77	314,701.77
利率敏感度缺口	2,842,234.18	-	57,110.44	98,145,014.55	101,044,359.17

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.06%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 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	119,054,439.19	98.50	97,967,998.40	96.96
交易性金融资产- 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产- 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权 证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	119,054,439.19	98.50	97,967,998.40	96.96

其他包含股指期货投资，于 2018 年 12 月 31 日，持仓数量为 2 手，合约市值为 1,613,040.00(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期



货投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日)	上年度末(2017年12月31日)
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	6,001,550.26	5,053,995.69
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-6,001,550.26	-5,053,995.69

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2018 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 158,988,932.65 元(2017 年度:81,249,278.45 元),其中包括以股票支付的申购款 49,144,879.80 元和以现金支付的申购款 109,844,052.85 元(2017 年度:其中包括以股票支付的申购款 23,269,600.90 元和以现金支付的申购款 57,979,677.55 元)。

##### (2) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 118,967,365.19 元,属于第二层次的余额为 87,074.00 元,无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日:第一层次 92,124,117.56 元,第二层次 5,900,991.28 元,无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额  
无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	119,054,439.19	97.10
	其中：股票	119,054,439.19	97.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,285,463.81	2.68
7	其他资产	269,727.08	0.22
8	合计	122,609,630.08	100.00

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

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,308,240.65	1.08
B	采矿业	2,574,784.28	2.13
C	制造业	75,084,411.56	62.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,402,050.12	2.81
E	建筑业	3,349,436.00	2.77
F	批发和零售业	4,253,377.17	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	2,716,284.32	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,732,486.14	10.53
J	金融业	874,036.80	0.72
K	房地产业	4,330,657.33	3.58
L	租赁和商务服务业	1,230,863.78	1.02
M	科学研究和技术服务业	1,585,206.10	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	1,554,072.20	1.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	89,976.00	0.07
Q	卫生和社会工作	972,044.80	0.80
R	文化、体育和娱乐业	2,018,907.94	1.67
S	综合	867,780.00	0.72
	合计	118,944,615.19	98.41

## 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	109,824.00	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	109,824.00	0.09

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 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

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

金额单位：

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	36,200	576,304.00	0.48
2	300176	鸿特科技	12,440	471,227.20	0.39
3	300601	康泰生物	12,740	455,837.20	0.38
4	002821	凯莱英	5,500	373,175.00	0.31
5	600873	梅花生物	87,300	368,406.00	0.30
6	600763	通策医疗	7,700	365,519.00	0.30
7	000735	罗牛山	36,900	356,454.00	0.29
8	002138	顺络电子	25,400	351,536.00	0.29
9	300012	华测检测	53,100	347,805.00	0.29
10	600675	中华企业	61,000	340,380.00	0.28
11	300203	聚光科技	12,700	325,755.00	0.27
12	002168	深圳惠程	32,700	323,403.00	0.27
13	600745	闻泰科技	15,300	323,289.00	0.27
14	300009	安科生物	23,958	320,078.88	0.26
15	300271	华宇软件	21,200	318,212.00	0.26
16	000917	电广传媒	45,400	314,168.00	0.26
17	000516	国际医学	63,100	312,345.00	0.26
18	600728	佳都科技	44,000	303,160.00	0.25
19	000040	东旭蓝天	41,700	301,491.00	0.25
20	600273	嘉化能源	33,500	301,165.00	0.25
21	300285	国瓷材料	18,000	300,060.00	0.25
22	600132	重庆啤酒	9,700	298,081.00	0.25
23	300073	当升科技	10,500	290,745.00	0.24
24	000883	湖北能源	78,400	287,728.00	0.24
25	600252	中恒集团	111,300	286,041.00	0.24

26	002376	新北洋	18,500	283,790.00	0.23
27	002383	合众思壮	23,900	282,737.00	0.23
28	002812	恩捷股份	5,700	281,637.00	0.23
29	300628	亿联网络	3,600	279,576.00	0.23
30	600486	扬农化工	7,400	278,684.00	0.23
31	002185	华天科技	68,300	277,298.00	0.23
32	600771	广誉远	9,600	277,152.00	0.23
33	002341	新纶科技	23,100	274,428.00	0.23
34	300170	汉得信息	28,000	273,840.00	0.23
35	300014	亿纬锂能	17,176	270,006.72	0.22
36	300207	欣旺达	31,000	266,290.00	0.22
37	000301	东方盛虹	48,500	264,810.00	0.22
38	000683	远兴能源	111,400	264,018.00	0.22
39	300036	超图软件	14,400	263,952.00	0.22
40	300038	数知科技	28,200	263,106.00	0.22
41	601799	星宇股份	5,500	261,250.00	0.22
42	600323	瀚蓝环境	18,400	258,152.00	0.21
43	002537	海联金汇	25,040	256,660.00	0.21
44	300180	华峰超纤	22,740	253,551.00	0.21
45	600320	振华重工	79,780	252,902.60	0.21
46	002157	正邦科技	47,200	250,632.00	0.21
47	002023	海特高新	24,200	250,470.00	0.21
48	300068	南都电源	17,600	250,272.00	0.21
49	603939	益丰药房	6,000	250,200.00	0.21
50	000591	太阳能	84,340	249,646.40	0.21
51	002035	华帝股份	28,200	249,570.00	0.21
52	601011	宝泰隆	45,300	249,150.00	0.21
53	000968	蓝焰控股	23,200	247,080.00	0.20
54	600702	舍得酒业	10,800	246,456.00	0.20
55	300558	贝达药业	7,700	246,169.00	0.20
56	601636	旗滨集团	64,600	245,480.00	0.20
57	600803	新奥股份	24,600	244,524.00	0.20
58	600596	新安股份	22,600	241,594.00	0.20
59	002396	星网锐捷	14,000	241,080.00	0.20
60	300188	美亚柏科	18,480	240,609.60	0.20
61	002126	银轮股份	32,200	239,568.00	0.20
62	300098	高新兴	35,320	238,763.20	0.20
63	600797	浙大网新	32,900	237,209.00	0.20
64	000902	新洋丰	26,200	234,752.00	0.19
65	600711	盛屯矿业	51,300	234,441.00	0.19
66	000697	炼石航空	18,800	232,932.00	0.19
67	300226	上海钢联	5,100	232,203.00	0.19
68	600490	鹏欣资源	50,700	230,685.00	0.19

69	600612	老凤祥	5,100	229,500.00	0.19
70	000059	华锦股份	38,400	228,096.00	0.19
71	002061	浙江交科	22,100	226,967.00	0.19
72	600529	山东药玻	11,900	226,100.00	0.19
73	002610	爱康科技	143,800	225,766.00	0.19
74	300451	创业软件	11,700	224,055.00	0.19
75	300377	赢时胜	20,150	222,456.00	0.18
76	002643	万润股份	21,850	221,122.00	0.18
77	002025	航天电器	10,300	220,729.00	0.18
78	002047	宝鹰股份	32,200	220,570.00	0.18
79	000918	嘉凯城	28,900	220,218.00	0.18
80	002511	中顺洁柔	25,795	219,773.40	0.18
81	300078	思创医惠	22,020	218,878.80	0.18
82	300037	新宙邦	9,100	218,855.00	0.18
83	603517	绝味食品	6,600	218,526.00	0.18
84	300212	易华录	10,500	217,560.00	0.18
85	002697	红旗连锁	42,400	217,512.00	0.18
86	600604	市北高新	28,200	217,422.00	0.18
87	002151	北斗星通	10,300	217,330.00	0.18
88	300222	科大智能	14,000	217,000.00	0.18
89	600868	梅雁吉祥	76,000	216,600.00	0.18
90	000800	一汽轿车	32,600	215,812.00	0.18
91	600845	宝信软件	10,300	214,755.00	0.18
92	300357	我武生物	5,800	214,542.00	0.18
93	002597	金禾实业	13,500	214,515.00	0.18
94	300496	中科创达	9,700	214,370.00	0.18
95	300529	健帆生物	5,100	211,650.00	0.18
96	002618	丹邦科技	15,350	211,369.50	0.17
97	002419	天虹股份	19,200	210,624.00	0.17
98	002421	达实智能	53,400	209,328.00	0.17
99	300476	胜宏科技	17,860	208,962.00	0.17
100	300747	锐科激光	1,500	206,400.00	0.17
101	002449	国星光电	19,850	206,043.00	0.17
102	601222	林洋能源	42,400	205,216.00	0.17
103	300149	量子生物	14,000	204,820.00	0.17
104	600185	格力地产	50,300	203,715.00	0.17
105	002313	日海智能	9,000	203,220.00	0.17
106	002042	华孚时尚	37,300	202,539.00	0.17
107	300457	赢合科技	7,250	201,912.50	0.17
108	300355	蒙草生态	51,440	200,101.60	0.17
109	600756	浪潮软件	13,000	198,770.00	0.16
110	000831	五矿稀土	23,630	197,783.10	0.16
111	600305	恒顺醋业	18,900	196,560.00	0.16

112	600446	金证股份	20,500	194,750.00	0.16
113	300284	苏交科	18,780	194,748.60	0.16
114	601058	赛轮轮胎	86,500	192,895.00	0.16
115	600562	国睿科技	14,910	191,891.70	0.16
116	300616	尚品宅配	3,140	190,817.80	0.16
117	000793	华闻传媒	64,100	190,377.00	0.16
118	000650	仁和药业	34,700	190,156.00	0.16
119	600175	美都能源	85,900	188,980.00	0.16
120	300079	数码科技	57,400	188,846.00	0.16
121	000836	富通鑫茂	48,400	188,276.00	0.16
122	002389	航天彩虹	15,400	188,034.00	0.16
123	002203	海亮股份	23,900	187,854.00	0.16
124	300294	博雅生物	6,950	187,580.50	0.16
125	601918	新集能源	62,200	187,222.00	0.15
126	600110	诺德股份	46,100	187,166.00	0.15
127	002237	恒邦股份	22,300	186,874.00	0.15
128	600783	鲁信创投	11,900	186,592.00	0.15
129	600337	美克家居	46,900	185,255.00	0.15
130	000150	宜华健康	12,560	185,008.80	0.15
131	600057	厦门象屿	44,246	184,948.28	0.15
132	002557	洽洽食品	9,700	184,688.00	0.15
133	002089	新海宜	42,900	184,470.00	0.15
134	600740	山西焦化	23,000	184,230.00	0.15
135	000818	航锦科技	19,900	183,677.00	0.15
136	002262	恩华药业	20,340	183,466.80	0.15
137	601375	中原证券	42,900	182,754.00	0.15
138	600269	赣粤高速	46,800	182,520.00	0.15
139	600326	西藏天路	28,120	182,217.60	0.15
140	300367	东方网力	20,500	181,835.00	0.15
141	600210	紫江企业	49,800	181,272.00	0.15
142	300458	全志科技	9,008	180,160.00	0.15
143	600226	瀚叶股份	64,194	179,743.20	0.15
144	300137	先河环保	22,020	179,463.00	0.15
145	002497	雅化集团	27,000	179,280.00	0.15
146	601929	吉视传媒	87,200	178,760.00	0.15
147	600123	兰花科创	27,400	178,648.00	0.15
148	002614	奥佳华	11,200	178,640.00	0.15
149	000933	神火股份	45,700	178,230.00	0.15
150	603323	吴江银行	29,000	177,190.00	0.15
151	002488	金固股份	26,700	177,021.00	0.15
152	000560	我爱我家	37,830	176,666.10	0.15
153	000739	普洛药业	23,700	176,328.00	0.15
154	000036	华联控股	32,000	176,320.00	0.15

155	000034	神州数码	13,100	176,195.00	0.15
156	600641	万业企业	19,400	176,152.00	0.15
157	603043	广州酒家	6,500	176,020.00	0.15
158	002091	江苏国泰	31,430	176,008.00	0.15
159	600330	天通股份	31,940	175,989.40	0.15
160	002099	海翔药业	38,900	175,828.00	0.15
161	000429	粤高速 A	20,900	175,351.00	0.15
162	600200	江苏吴中	29,600	175,232.00	0.14
163	603678	火炬电子	11,100	175,047.00	0.14
164	600116	三峡水利	23,900	174,948.00	0.14
165	300618	寒锐钴业	2,340	173,347.20	0.14
166	601588	北辰实业	63,900	173,169.00	0.14
167	002382	蓝帆医疗	11,600	172,376.00	0.14
168	600667	太极实业	33,700	172,207.00	0.14
169	300102	乾照光电	29,500	171,985.00	0.14
170	300054	鼎龙股份	26,980	171,862.60	0.14
171	300326	凯利泰	20,200	171,700.00	0.14
172	000989	九芝堂	17,400	170,694.00	0.14
173	002073	软控股份	37,500	169,875.00	0.14
174	002402	和而泰	27,450	169,641.00	0.14
175	002020	京新药业	19,700	169,420.00	0.14
176	300185	通裕重工	104,700	168,567.00	0.14
177	000875	吉电股份	68,800	168,560.00	0.14
178	002130	沃尔核材	51,800	167,832.00	0.14
179	600033	福建高速	56,500	167,805.00	0.14
180	002145	中核钛白	52,100	167,762.00	0.14
181	002108	沧州明珠	39,789	167,511.69	0.14
182	000507	珠海港	25,300	166,980.00	0.14
183	300482	万孚生物	6,571	166,969.11	0.14
184	601666	平煤股份	47,300	166,496.00	0.14
185	600491	龙元建设	24,500	165,865.00	0.14
186	603718	海利生物	13,100	165,846.00	0.14
187	600577	精达股份	55,800	165,726.00	0.14
188	000592	平潭发展	62,000	165,540.00	0.14
189	002737	葵花药业	11,200	165,536.00	0.14
190	300077	国民技术	22,400	165,536.00	0.14
191	600559	老白干酒	13,380	165,376.80	0.14
192	002648	卫星石化	17,100	165,357.00	0.14
193	002716	金贵银业	26,970	165,326.10	0.14
194	600108	亚盛集团	62,500	165,000.00	0.14
195	300463	迈克生物	11,300	164,980.00	0.14
196	300053	欧比特	20,200	164,832.00	0.14
197	603338	浙江鼎力	2,920	164,454.40	0.14



198	600851	海欣股份	23,600	163,784.00	0.14
199	000035	中国天楹	31,400	163,280.00	0.14
200	603660	苏州科达	9,780	163,032.60	0.13
201	600668	尖峰集团	13,800	162,840.00	0.13
202	600742	一汽富维	16,260	162,274.80	0.13
203	002436	兴森科技	35,800	161,816.00	0.13
204	002067	景兴纸业	46,100	161,811.00	0.13
205	002727	一心堂	9,100	161,798.00	0.13
206	002413	雷科防务	30,100	161,035.00	0.13
207	002124	天邦股份	23,650	160,820.00	0.13
208	600720	祁连山	24,900	160,605.00	0.13
209	000789	万年青	14,700	160,083.00	0.13
210	000603	盛达矿业	16,000	160,000.00	0.13
211	600230	沧州大化	9,880	159,562.00	0.13
212	600622	光大嘉宝	28,116	159,417.72	0.13
213	601369	陕鼓动力	26,300	159,115.00	0.13
214	300495	美尚生态	12,050	159,060.00	0.13
215	600477	杭萧钢构	44,017	158,461.20	0.13
216	002531	天顺风能	35,600	158,420.00	0.13
217	600708	光明地产	45,304	158,110.96	0.13
218	000688	国城矿业	13,700	158,098.00	0.13
219	002156	通富微电	22,100	157,573.00	0.13
220	300699	光威复材	4,400	157,520.00	0.13
221	600206	有研新材	24,100	157,373.00	0.13
222	600067	冠城大通	42,300	157,356.00	0.13
223	603368	柳药股份	5,992	156,990.40	0.13
224	300567	精测电子	3,100	156,488.00	0.13
225	600420	现代制药	17,100	156,294.00	0.13
226	000088	盐田港	31,100	155,500.00	0.13
227	300101	振芯科技	15,700	155,430.00	0.13
228	600988	赤峰黄金	38,800	154,812.00	0.13
229	002022	科华生物	16,500	154,770.00	0.13
230	002219	恒康医疗	44,900	154,456.00	0.13
231	002364	中恒电气	13,100	154,056.00	0.13
232	002596	海南瑞泽	25,700	153,943.00	0.13
233	002215	诺普信	22,600	152,776.00	0.13
234	600400	红豆股份	40,620	152,325.00	0.13
235	000901	航天科技	17,200	152,048.00	0.13
236	601069	西部黄金	10,200	151,674.00	0.13
237	603708	家家悦	7,540	151,478.60	0.13
238	000882	华联股份	67,800	151,194.00	0.13
239	600162	香江控股	69,000	150,420.00	0.12
240	300145	中金环境	46,260	150,345.00	0.12

241	600764	中国海防	6,300	150,192.00	0.12
242	002318	久立特材	23,600	149,624.00	0.12
243	600502	安徽水利	42,000	149,520.00	0.12
244	600621	华鑫股份	17,000	149,260.00	0.12
245	600681	百川能源	12,600	149,184.00	0.12
246	000620	新华联	38,100	148,971.00	0.12
247	002117	东港股份	10,500	148,575.00	0.12
248	600997	开滦股份	26,200	148,554.00	0.12
249	000016	深康佳 A	45,800	148,392.00	0.12
250	002547	春兴精工	28,000	148,120.00	0.12
251	002292	奥飞娱乐	26,100	147,726.00	0.12
252	000676	智度股份	15,500	147,095.00	0.12
253	600986	科达股份	35,040	146,817.60	0.12
254	000799	酒鬼酒	9,100	145,418.00	0.12
255	601113	华鼎股份	17,900	145,169.00	0.12
256	300339	润和软件	15,900	145,008.00	0.12
257	600789	鲁抗医药	19,200	144,960.00	0.12
258	000733	振华科技	13,200	144,408.00	0.12
259	600285	羚锐制药	19,200	144,384.00	0.12
260	000546	金圆股份	16,600	143,756.00	0.12
261	002717	岭南股份	16,090	143,361.90	0.12
262	600846	同济科技	20,000	143,000.00	0.12
263	600677	航天通信	15,100	142,997.00	0.12
264	000935	四川双马	9,500	142,880.00	0.12
265	002370	亚太药业	8,600	142,846.00	0.12
266	002303	美盈森	30,700	142,755.00	0.12
267	600308	华泰股份	32,800	142,680.00	0.12
268	600495	晋西车轴	34,700	142,617.00	0.12
269	002258	利尔化学	10,800	141,912.00	0.12
270	000851	高鸿股份	29,780	141,752.80	0.12
271	002343	慈文传媒	15,620	140,892.40	0.12
272	300309	吉艾科技	17,480	140,888.80	0.12
273	002097	山河智能	25,357	140,731.35	0.12
274	600197	伊力特	10,800	140,724.00	0.12
275	300292	吴通控股	36,800	140,576.00	0.12
276	000869	张裕 A	5,400	140,400.00	0.12
277	002550	千红制药	36,900	140,220.00	0.12
278	300595	欧普康视	3,600	139,464.00	0.12
279	300047	天源迪科	12,500	138,875.00	0.11
280	601886	江河集团	18,500	138,565.00	0.11
281	300369	绿盟科技	16,000	138,560.00	0.11
282	600856	中天能源	37,200	138,384.00	0.11
283	002429	兆驰股份	72,500	137,750.00	0.11

284	002326	永太科技	19,701	137,709.99	0.11
285	600512	腾达建设	64,000	137,600.00	0.11
286	000672	上峰水泥	16,300	137,572.00	0.11
287	002430	杭氧股份	14,700	137,445.00	0.11
288	300429	强力新材	4,400	137,280.00	0.11
289	000710	贝瑞基因	4,300	137,170.00	0.11
290	002192	融捷股份	7,500	136,800.00	0.11
291	002585	双星新材	26,820	136,782.00	0.11
292	002104	恒宝股份	23,316	136,631.76	0.11
293	600076	康欣新材	33,300	136,530.00	0.11
294	603337	杰克股份	3,720	136,486.80	0.11
295	000555	神州信息	14,600	136,364.00	0.11
296	300666	江丰电子	3,300	136,356.00	0.11
297	300365	恒华科技	6,500	135,850.00	0.11
298	000666	经纬纺机	12,600	135,828.00	0.11
299	300523	辰安科技	2,280	135,660.00	0.11
300	002657	中科金财	10,800	135,648.00	0.11
301	000525	红太阳	9,600	134,688.00	0.11
302	600546	山煤国际	40,500	134,460.00	0.11
303	600966	博汇纸业	42,800	134,392.00	0.11
304	600715	文投控股	29,800	134,100.00	0.11
305	600990	四创电子	3,900	133,731.00	0.11
306	002222	福晶科技	13,700	133,712.00	0.11
307	300352	北信源	40,600	133,574.00	0.11
308	002036	联创电子	15,500	133,300.00	0.11
309	000910	大亚圣象	12,900	132,999.00	0.11
310	600422	昆药集团	21,500	132,870.00	0.11
311	600456	宝钛股份	8,800	132,792.00	0.11
312	002031	巨轮智能	70,500	132,540.00	0.11
313	600020	中原高速	36,000	132,120.00	0.11
314	300349	金卡智能	8,200	132,020.00	0.11
315	600105	永鼎股份	34,080	131,548.80	0.11
316	002267	陕天然气	17,800	131,542.00	0.11
317	002115	三维通信	13,300	131,271.00	0.11
318	000751	锌业股份	46,000	131,100.00	0.11
319	600812	华北制药	32,700	130,800.00	0.11
320	002668	奥马电器	26,856	130,788.72	0.11
321	002327	富安娜	17,400	130,674.00	0.11
322	002675	东诚药业	16,600	130,642.00	0.11
323	000687	华讯方舟	18,400	130,640.00	0.11
324	002447	晨鑫科技	44,500	130,385.00	0.11
325	002425	凯撒文化	22,160	130,300.80	0.11
326	300323	华灿光电	18,000	130,140.00	0.11

327	600172	黄河旋风	42,640	130,052.00	0.11
328	002647	仁东控股	9,000	129,960.00	0.11
329	600255	梦舟股份	72,100	129,780.00	0.11
330	601908	京运通	41,200	129,780.00	0.11
331	600239	云南城投	45,050	129,744.00	0.11
332	600093	易见股份	17,100	129,618.00	0.11
333	603096	新经典	2,100	129,612.00	0.11
334	300178	腾邦国际	14,300	129,272.00	0.11
335	000828	东莞控股	17,300	129,231.00	0.11
336	002564	天沃科技	25,700	129,014.00	0.11
337	002256	兆新股份	43,700	128,915.00	0.11
338	603345	安井食品	3,500	128,800.00	0.11
339	600059	古越龙山	19,500	128,700.00	0.11
340	603399	吉翔股份	13,100	128,642.00	0.11
341	002467	二六三	25,400	128,524.00	0.11
342	002003	伟星股份	18,300	128,466.00	0.11
343	000921	海信家电	18,100	127,967.00	0.11
344	600133	东湖高新	20,300	127,890.00	0.11
345	300177	中海达	12,500	127,875.00	0.11
346	600227	圣济堂	46,300	127,788.00	0.11
347	000802	北京文化	11,500	127,305.00	0.11
348	002206	海利得	33,250	126,682.50	0.10
349	300219	鸿利智汇	16,500	126,390.00	0.10
350	603588	高能环境	16,100	126,385.00	0.10
351	000936	华西股份	20,600	126,072.00	0.10
352	300252	金信诺	11,550	125,895.00	0.10
353	600090	同济堂	23,100	125,664.00	0.10
354	002080	中材科技	15,520	125,556.80	0.10
355	600360	华微电子	24,400	125,416.00	0.10
356	300075	数字政通	11,500	125,350.00	0.10
357	300031	宝通科技	9,500	125,305.00	0.10
358	601139	深圳燃气	23,320	125,228.40	0.10
359	600987	航民股份	15,300	125,154.00	0.10
360	603128	华贸物流	23,500	125,020.00	0.10
361	002387	维信诺	16,400	124,968.00	0.10
362	603707	健友股份	6,650	124,820.50	0.10
363	601677	明泰铝业	14,200	124,818.00	0.10
364	600072	中船科技	17,900	124,763.00	0.10
365	002139	拓邦股份	31,800	124,656.00	0.10
366	600261	阳光照明	36,400	124,124.00	0.10
367	002446	盛路通信	15,610	123,475.10	0.10
368	300208	恒顺众昇	21,500	123,410.00	0.10
369	300630	普利制药	2,800	123,368.00	0.10

370	002649	博彦科技	16,800	123,144.00	0.10
371	300300	汉鼎宇佑	10,950	122,640.00	0.10
372	002626	金达威	10,200	122,604.00	0.10
373	300020	银江股份	18,900	122,472.00	0.10
374	300039	上海凯宝	30,100	122,206.00	0.10
375	600063	皖维高新	52,400	122,092.00	0.10
376	002095	生意宝	6,200	122,016.00	0.10
377	002698	博实股份	13,700	121,793.00	0.10
378	000582	北部湾港	17,300	121,792.00	0.10
379	002484	江海股份	19,590	120,674.40	0.10
380	002859	洁美科技	3,900	119,925.00	0.10
381	603989	艾华集团	5,950	119,833.00	0.10
382	300568	星源材质	5,400	119,826.00	0.10
383	603357	设计总院	6,000	119,700.00	0.10
384	603113	金能科技	10,900	119,573.00	0.10
385	300118	东方日升	21,000	119,490.00	0.10
386	000797	中国武夷	26,241	119,396.55	0.10
387	300474	景嘉微	3,300	119,328.00	0.10
388	002721	金一文化	18,700	119,306.00	0.10
389	000951	中国重汽	10,700	119,198.00	0.10
390	002171	楚江新材	25,700	118,991.00	0.10
391	000731	四川美丰	23,700	118,974.00	0.10
392	600322	天房发展	36,600	118,950.00	0.10
393	300096	易联众	14,400	118,944.00	0.10
394	002542	中化岩土	27,500	118,250.00	0.10
395	300409	道氏技术	9,000	117,990.00	0.10
396	600569	安阳钢铁	38,900	117,867.00	0.10
397	600343	航天动力	15,500	117,800.00	0.10
398	300044	赛为智能	19,420	117,491.00	0.10
399	002113	天润数娱	31,280	117,300.00	0.10
400	000976	华铁股份	25,600	117,248.00	0.10
401	002309	中利集团	14,000	116,760.00	0.10
402	000520	长航凤凰	40,500	116,640.00	0.10
403	600217	中再资环	28,500	116,565.00	0.10
404	300085	银之杰	14,600	116,216.00	0.10
405	600624	复旦复华	19,200	116,160.00	0.10
406	300232	洲明科技	12,160	116,006.40	0.10
407	601101	昊华能源	19,300	115,993.00	0.10
408	000571	新大洲A	33,800	115,934.00	0.10
409	000996	中国中期	13,850	115,786.00	0.10
410	603039	泛微网络	1,600	115,680.00	0.10
411	002462	嘉事堂	8,000	115,600.00	0.10
412	600363	联创光电	14,400	115,200.00	0.10

413	600114	东睦股份	18,372	115,192.44	0.10
414	600331	宏达股份	57,000	115,140.00	0.10
415	002307	北新路桥	21,540	115,023.60	0.10
416	600508	上海能源	11,900	114,835.00	0.10
417	002501	利源精制	40,400	114,332.00	0.09
418	002619	艾格拉斯	33,880	114,175.60	0.09
419	300183	东软载波	9,700	114,169.00	0.09
420	000915	山大华特	7,710	114,108.00	0.09
421	002747	埃斯顿	13,400	114,034.00	0.09
422	002705	新宝股份	12,400	113,832.00	0.09
423	600300	维维股份	40,300	113,646.00	0.09
424	600963	岳阳林纸	28,300	113,483.00	0.09
425	002148	北纬科技	19,000	113,430.00	0.09
426	002301	齐心集团	13,400	113,364.00	0.09
427	002792	通宇通讯	3,700	113,294.00	0.09
428	000889	中嘉博创	11,100	113,220.00	0.09
429	300438	鹏辉能源	7,000	113,120.00	0.09
430	000928	中钢国际	25,900	112,665.00	0.09
431	300128	锦富技术	31,205	112,650.05	0.09
432	600568	中珠医疗	49,400	112,632.00	0.09
433	002474	榕基软件	18,100	112,220.00	0.09
434	002261	拓维信息	26,500	111,830.00	0.09
435	000584	哈工智能	17,800	111,784.00	0.09
436	600550	保变电气	30,300	111,504.00	0.09
437	300373	扬杰科技	7,700	111,188.00	0.09
438	000550	江铃汽车	8,700	111,012.00	0.09
439	300379	东方通	7,900	110,995.00	0.09
440	002240	威华股份	15,200	110,808.00	0.09
441	600581	八一钢铁	31,100	110,716.00	0.09
442	002630	华西能源	38,760	110,466.00	0.09
443	000801	四川九洲	25,500	110,415.00	0.09
444	002367	康力电梯	19,800	110,286.00	0.09
445	300602	飞荣达	3,300	110,253.00	0.09
446	000155	川能动力	30,500	109,800.00	0.09
447	002355	兴民智通	14,500	109,765.00	0.09
448	300685	艾德生物	2,680	109,638.80	0.09
449	601388	怡球资源	56,800	109,624.00	0.09
450	601952	苏垦农发	16,510	109,461.30	0.09
451	603882	金域医学	4,900	109,172.00	0.09
452	300237	美晨生态	30,060	109,117.80	0.09
453	300322	硕贝德	11,400	108,756.00	0.09
454	600106	重庆路桥	35,884	108,728.52	0.09
455	600130	波导股份	30,800	108,724.00	0.09

456	000030	富奥股份	29,300	108,703.00	0.09
457	600684	珠江实业	24,960	108,576.00	0.09
458	300045	华力创通	14,300	108,394.00	0.09
459	600590	泰豪科技	20,110	108,392.90	0.09
460	002293	罗莱生活	12,500	108,125.00	0.09
461	601163	三角轮胎	9,700	108,058.00	0.09
462	300130	新国都	9,540	107,992.80	0.09
463	002298	中电兴发	18,300	107,970.00	0.09
464	002867	周大生	3,900	107,757.00	0.09
465	600676	交运股份	25,000	107,750.00	0.09
466	600096	云天化	21,500	107,715.00	0.09
467	300310	宜通世纪	21,240	107,686.80	0.09
468	603699	纽威股份	9,000	107,550.00	0.09
469	002245	澳洋顺昌	27,700	107,476.00	0.09
470	002055	得润电子	11,100	107,337.00	0.09
471	000822	山东海化	22,100	107,185.00	0.09
472	600075	新疆天业	23,700	107,124.00	0.09
473	600602	云赛智联	21,500	107,070.00	0.09
474	600531	豫光金铅	30,600	106,794.00	0.09
475	300398	飞凯材料	6,800	106,760.00	0.09
476	000967	盈峰环境	18,890	106,728.50	0.09
477	600459	贵研铂业	9,620	106,589.60	0.09
478	300131	英唐智控	24,800	106,392.00	0.09
479	002320	海峡股份	7,900	106,255.00	0.09
480	600211	西藏药业	3,600	106,236.00	0.09
481	002229	鸿博股份	14,600	106,142.00	0.09
482	300477	合纵科技	11,700	106,002.00	0.09
483	002851	麦格米特	5,000	106,000.00	0.09
484	002283	天润曲轴	31,600	105,860.00	0.09
485	603605	珀莱雅	2,400	105,768.00	0.09
486	600662	强生控股	25,500	105,570.00	0.09
487	300467	迅游科技	4,600	105,478.00	0.09
488	002279	久其软件	14,830	105,441.30	0.09
489	002912	中新赛克	1,300	105,378.00	0.09
490	300348	长亮科技	6,400	105,152.00	0.09
491	002167	东方锆业	19,900	105,072.00	0.09
492	002433	太安堂	22,400	105,056.00	0.09
493	002428	云南锆业	21,000	105,000.00	0.09
494	002448	中原内配	19,500	104,910.00	0.09
495	300353	东土科技	12,000	104,760.00	0.09
496	002611	东方精工	27,900	104,625.00	0.09
497	300288	朗玛信息	8,100	104,490.00	0.09
498	000615	京汉股份	19,600	104,076.00	0.09

499	600391	航发科技	9,500	103,835.00	0.09
500	603636	南威软件	10,799	103,670.40	0.09
501	002197	证通电子	14,800	103,600.00	0.09
502	000973	佛塑科技	32,100	103,041.00	0.09
503	002510	天 汽 模	28,700	103,033.00	0.09
504	603456	九洲药业	16,200	103,032.00	0.09
505	603118	共进股份	16,300	102,690.00	0.08
506	002141	贤丰控股	23,700	102,621.00	0.08
507	000407	胜利股份	27,500	102,575.00	0.08
508	601366	利群股份	15,800	102,384.00	0.08
509	300406	九强生物	10,400	102,232.00	0.08
510	002664	长鹰信质	8,300	101,924.00	0.08
511	300364	中文在线	21,056	101,911.04	0.08
512	002043	兔 宝 宝	20,100	101,907.00	0.08
513	002226	江南化工	20,000	101,800.00	0.08
514	603638	艾迪精密	4,200	101,682.00	0.08
515	300065	海 兰 信	9,900	101,178.00	0.08
516	600800	天津磁卡	20,100	100,701.00	0.08
517	000958	东方能源	31,200	100,464.00	0.08
518	300016	北陆药业	14,350	100,450.00	0.08
519	300223	北京君正	5,499	100,356.75	0.08
520	300336	新 文 化	22,800	100,320.00	0.08
521	000043	中航善达	13,400	100,232.00	0.08
522	002305	南国置业	34,700	99,936.00	0.08
523	002224	三 力 士	18,500	99,900.00	0.08
524	000913	钱江摩托	10,900	99,844.00	0.08
525	002453	华软科技	19,200	99,840.00	0.08
526	002650	加加食品	27,700	99,720.00	0.08
527	300456	耐威科技	4,500	99,540.00	0.08
528	300298	三诺生物	9,380	99,428.00	0.08
529	601126	四方股份	19,500	99,255.00	0.08
530	300236	上海新阳	4,000	99,240.00	0.08
531	000810	创维数字	17,800	98,968.00	0.08
532	002567	唐 人 神	17,450	98,941.50	0.08
533	000065	北方国际	12,875	98,880.00	0.08
534	002540	亚太科技	21,400	98,868.00	0.08
535	600054	黄山旅游	10,500	98,490.00	0.08
536	002121	科陆电子	21,400	98,440.00	0.08
537	600626	申达股份	19,900	98,306.00	0.08
538	300502	新 易 盛	5,000	98,250.00	0.08
539	002768	国恩股份	4,400	98,120.00	0.08
540	002568	百润股份	10,700	97,798.00	0.08
541	002677	浙江美大	9,800	97,706.00	0.08



542	603393	新天然气	3,200	97,600.00	0.08
543	300388	国祯环保	11,000	97,350.00	0.08
544	002182	云海金属	15,600	97,344.00	0.08
545	600055	万东医疗	11,200	97,216.00	0.08
546	600069	银鸽投资	33,400	97,194.00	0.08
547	002210	飞马国际	26,470	97,144.90	0.08
548	000601	韶能股份	25,991	96,686.52	0.08
549	603026	石大胜华	5,000	96,500.00	0.08
550	603359	东珠生态	5,880	96,314.40	0.08
551	600638	新黄浦	11,300	96,276.00	0.08
552	300231	银信科技	14,800	96,200.00	0.08
553	600129	太极集团	11,500	96,025.00	0.08
554	000821	京山轻机	12,500	95,750.00	0.08
555	002253	川大智胜	7,200	95,184.00	0.08
556	002239	奥特佳	47,580	95,160.00	0.08
557	300007	汉威科技	9,700	95,157.00	0.08
558	300506	名家汇	6,600	95,040.00	0.08
559	300157	恒泰艾普	22,900	95,035.00	0.08
560	300091	金通灵	28,080	94,629.60	0.08
561	600693	东百集团	18,005	94,526.25	0.08
562	002204	大连重工	31,900	94,424.00	0.08
563	600798	宁波海运	29,200	94,316.00	0.08
564	300148	天舟文化	21,130	94,028.50	0.08
565	600318	新力金融	13,200	93,984.00	0.08
566	603458	勘设股份	3,100	93,775.00	0.08
567	002314	南山控股	32,600	93,562.00	0.08
568	603108	润达医疗	12,980	93,326.20	0.08
569	600231	凌钢股份	34,940	93,289.80	0.08
570	002582	好想你	12,400	93,248.00	0.08
571	002443	金洲管道	17,500	92,925.00	0.08
572	002522	浙江众成	19,000	92,910.00	0.08
573	300343	联创互联	13,900	92,852.00	0.08
574	601566	九牧王	7,000	92,750.00	0.08
575	600103	青山纸业	36,100	92,416.00	0.08
576	000070	特发信息	13,000	92,300.00	0.08
577	002005	德豪润达	42,500	92,225.00	0.08
578	300228	富瑞特装	19,000	91,960.00	0.08
579	002060	粤水电	33,800	91,936.00	0.08
580	300050	世纪鼎利	14,800	91,908.00	0.08
581	002094	青岛金王	18,860	91,848.20	0.08
582	000711	京蓝科技	14,740	91,830.20	0.08
583	002556	辉隆股份	17,900	91,469.00	0.08
584	300198	纳川股份	32,200	91,448.00	0.08

585	000055	方大集团	22,850	91,400.00	0.08
586	002617	露笑科技	22,950	91,341.00	0.08
587	600707	彩虹股份	22,100	91,273.00	0.08
588	002016	世荣兆业	10,100	91,102.00	0.08
589	300431	暴风集团	10,920	91,072.80	0.08
590	002545	东方铁塔	15,500	90,830.00	0.08
591	002726	龙大肉食	11,470	90,727.70	0.08
592	000498	山东路桥	17,900	90,574.00	0.07
593	300679	电连技术	3,320	90,536.40	0.07
594	002616	长青集团	12,400	90,520.00	0.07
595	603979	金诚信	12,072	90,419.28	0.07
596	300034	钢研高纳	10,500	90,300.00	0.07
597	000545	金浦钛业	28,800	90,144.00	0.07
598	600661	昂立教育	4,600	89,976.00	0.07
599	601949	中国出版	20,400	89,556.00	0.07
600	000892	欢瑞世纪	18,800	89,488.00	0.07
601	600652	游久游戏	20,000	89,400.00	0.07
602	601116	三江购物	8,300	89,391.00	0.07
603	300661	圣邦股份	1,300	89,180.00	0.07
604	002521	齐峰新材	16,000	89,120.00	0.07
605	002335	科华恒盛	5,900	88,913.00	0.07
606	600995	文山电力	13,400	88,574.00	0.07
607	000631	顺发恒业	29,800	88,506.00	0.07
608	002543	万和电气	6,880	88,408.00	0.07
609	002756	永兴特钢	7,400	88,208.00	0.07
610	002929	润建通信	2,700	88,182.00	0.07
611	000965	天保基建	22,800	87,780.00	0.07
612	600480	凌云股份	11,500	87,745.00	0.07
613	603808	歌力思	5,400	87,696.00	0.07
614	002746	仙坛股份	6,410	87,688.80	0.07
615	002235	安妮股份	17,000	87,550.00	0.07
616	600012	皖通高速	14,500	87,435.00	0.07
617	600180	瑞茂通	12,400	87,420.00	0.07
618	600382	广东明珠	11,300	87,236.00	0.07
619	300205	天喻信息	10,700	87,098.00	0.07
620	601700	风范股份	22,800	87,096.00	0.07
621	002636	金安国纪	12,200	86,986.00	0.07
622	600449	宁夏建材	11,800	86,966.00	0.07
623	002586	围海股份	19,200	86,784.00	0.07
624	000820	神雾节能	15,500	86,645.00	0.07
625	300303	聚飞光电	35,600	86,508.00	0.07
626	600630	龙头股份	12,500	86,375.00	0.07
627	002516	旷达科技	30,400	86,336.00	0.07

628	600571	信雅达	13,700	86,310.00	0.07
629	603298	杭叉集团	7,300	86,286.00	0.07
630	002068	黑猫股份	14,600	86,140.00	0.07
631	300233	金城医药	6,300	85,995.00	0.07
632	300066	三川智慧	25,900	85,988.00	0.07
633	002538	司尔特	17,800	85,974.00	0.07
634	002662	京威股份	22,800	85,956.00	0.07
635	600246	万通地产	25,700	85,838.00	0.07
636	002135	东南网架	17,300	85,808.00	0.07
637	300410	正业科技	3,800	85,690.00	0.07
638	300005	探路者	26,100	85,347.00	0.07
639	002581	未名医药	13,200	85,272.00	0.07
640	600303	曙光股份	21,800	85,238.00	0.07
641	002451	摩恩电气	7,000	85,190.00	0.07
642	603305	旭升股份	2,800	85,176.00	0.07
643	002656	摩登大道	13,720	85,064.00	0.07
644	603308	应流股份	10,600	85,012.00	0.07
645	000532	华金资本	8,600	84,882.00	0.07
646	603728	鸣志电器	6,700	84,755.00	0.07
647	603980	吉华集团	7,200	84,744.00	0.07
648	002234	民和股份	7,400	84,730.00	0.07
649	002502	骅威文化	21,500	84,710.00	0.07
650	300229	拓尔思	9,800	84,574.00	0.07
651	002079	苏州固锝	18,100	84,527.00	0.07
652	300424	航新科技	6,055	84,406.70	0.07
653	600686	金龙汽车	12,300	84,255.00	0.07
654	600467	好当家	35,100	84,240.00	0.07
655	002218	拓日新能	30,600	84,150.00	0.07
656	603881	数据港	3,400	84,116.00	0.07
657	002362	汉王科技	6,300	84,105.00	0.07
658	002515	金字火腿	20,060	84,051.40	0.07
659	300238	冠昊生物	8,800	83,952.00	0.07
660	300741	华宝股份	2,700	83,889.00	0.07
661	600035	楚天高速	28,400	83,780.00	0.07
662	600165	新日恒力	17,200	83,764.00	0.07
663	000811	冰轮环境	16,200	83,754.00	0.07
664	000795	英洛华	23,400	83,538.00	0.07
665	603367	辰欣药业	5,500	83,490.00	0.07
666	603003	龙宇燃油	12,400	83,452.00	0.07
667	000881	中广核技	12,400	83,328.00	0.07
668	000925	众合科技	14,220	83,187.00	0.07
669	300184	力源信息	10,900	82,949.00	0.07
670	002101	广东鸿图	10,250	82,922.50	0.07

671	002086	东方海洋	19,000	82,840.00	0.07
672	000639	西王食品	12,900	82,689.00	0.07
673	601599	鹿港文化	26,400	82,368.00	0.07
674	600084	中葡股份	28,000	82,320.00	0.07
675	002622	融钰集团	26,900	82,314.00	0.07
676	300158	振东制药	21,600	82,296.00	0.07
677	300123	亚光科技	9,000	82,170.00	0.07
678	300248	新开普	12,091	82,097.89	0.07
679	603111	康尼机电	20,700	81,972.00	0.07
680	002458	益生股份	5,700	81,795.00	0.07
681	300497	富祥股份	4,500	81,720.00	0.07
682	300064	豫金刚石	18,300	81,618.00	0.07
683	300299	富春股份	16,895	81,602.85	0.07
684	002349	精华制药	14,200	81,366.00	0.07
685	300224	正海磁材	13,800	81,282.00	0.07
686	600552	凯盛科技	22,100	81,107.00	0.07
687	300215	电科院	15,300	81,090.00	0.07
688	002481	双塔食品	28,900	80,920.00	0.07
689	600136	当代明诚	9,900	80,883.00	0.07
690	300269	联建光电	14,700	80,850.00	0.07
691	300386	飞天诚信	8,000	80,720.00	0.07
692	000927	一汽夏利	25,600	80,640.00	0.07
693	002321	华英农业	15,600	80,496.00	0.07
694	002409	雅克科技	5,800	80,446.00	0.07
695	603686	龙马环卫	7,400	80,364.00	0.07
696	601890	亚星锚链	22,800	80,256.00	0.07
697	002638	勤上股份	31,200	80,184.00	0.07
698	002769	普路通	7,900	80,106.00	0.07
699	300143	星普医科	8,800	79,992.00	0.07
700	300363	博腾股份	9,000	79,740.00	0.07
701	000815	美利云	11,800	79,650.00	0.07
702	002539	云图控股	19,400	79,540.00	0.07
703	600595	中孚实业	41,000	79,540.00	0.07
704	002695	煌上煌	8,000	79,520.00	0.07
705	300191	潜能恒信	5,400	79,488.00	0.07
706	300021	大禹节水	19,150	79,472.50	0.07
707	002033	丽江旅游	14,010	79,436.70	0.07
708	000657	中钨高新	14,860	79,055.20	0.07
709	002711	欧浦智网	20,320	79,044.80	0.07
710	002554	惠博普	29,100	78,861.00	0.07
711	300531	优博讯	4,700	78,819.00	0.07
712	600619	海立股份	9,300	78,771.00	0.07
713	603599	广信股份	7,500	78,750.00	0.07

714	002166	莱茵生物	12,800	78,592.00	0.07
715	000544	中原环保	15,500	78,585.00	0.07
716	300110	华仁药业	24,460	78,516.60	0.06
717	600734	实达集团	12,500	78,500.00	0.06
718	300048	合康新能	32,840	78,487.60	0.06
719	000791	甘肃电投	15,500	78,430.00	0.06
720	300083	劲胜智能	33,200	78,352.00	0.06
721	603609	禾丰牧业	10,100	78,275.00	0.06
722	300256	星星科技	26,350	78,259.50	0.06
723	002284	亚太股份	18,400	78,200.00	0.06
724	300245	天玑科技	9,100	78,078.00	0.06
725	600855	航天长峰	8,600	77,658.00	0.06
726	300439	美康生物	5,800	77,488.00	0.06
727	000673	当代东方	16,500	77,385.00	0.06
728	002653	海思科	6,500	77,285.00	0.06
729	300213	佳讯飞鸿	13,800	77,142.00	0.06
730	300633	开立医疗	2,800	77,140.00	0.06
731	000957	中通客车	17,300	76,985.00	0.06
732	300262	巴安水务	14,150	76,976.00	0.06
733	600523	贵航股份	8,080	76,921.60	0.06
734	601858	中国科传	8,800	76,912.00	0.06
735	300607	拓斯达	2,500	76,875.00	0.06
736	002393	力生制药	3,560	76,646.80	0.06
737	300485	赛升药业	7,800	76,518.00	0.06
738	002609	捷顺科技	13,800	76,452.00	0.06
739	600533	栖霞建设	26,000	76,440.00	0.06
740	000837	秦川机床	19,400	76,242.00	0.06
741	002562	兄弟科技	17,920	76,160.00	0.06
742	300317	珈伟新能	16,193	76,107.10	0.06
743	300006	莱美药业	21,100	75,960.00	0.06
744	002247	聚力文化	16,300	75,958.00	0.06
745	601330	绿色动力	6,100	75,945.00	0.06
746	000151	中成股份	7,400	75,776.00	0.06
747	603618	杭电股份	14,500	75,690.00	0.06
748	300332	天壕环境	20,500	75,645.00	0.06
749	603508	思维列控	1,900	75,639.00	0.06
750	603008	喜临门	8,200	75,604.00	0.06
751	300311	任子行	13,005	75,559.05	0.06
752	603603	博天环境	5,100	75,480.00	0.06
753	000404	长虹华意	19,525	75,366.50	0.06
754	000971	高升控股	22,700	75,364.00	0.06
755	603959	百利科技	5,100	75,327.00	0.06
756	000665	湖北广电	10,500	75,180.00	0.06

757	603898	好莱客	4,900	75,117.00	0.06
758	300097	智云股份	6,700	74,839.00	0.06
759	000558	莱茵体育	25,800	74,820.00	0.06
760	000923	河北宣工	5,500	74,800.00	0.06
761	002833	弘亚数控	2,200	74,800.00	0.06
762	000038	深大通	5,860	74,773.60	0.06
763	603387	基蛋生物	2,800	74,396.00	0.06
764	300359	全通教育	12,700	74,295.00	0.06
765	600295	鄂尔多斯	9,900	74,250.00	0.06
766	002584	西陇科学	12,300	74,169.00	0.06
767	300366	创意信息	10,100	73,932.00	0.06
768	000058	深赛格	12,400	73,780.00	0.06
769	600290	华仪电气	15,900	73,776.00	0.06
770	600650	锦江投资	7,800	73,710.00	0.06
771	300255	常山药业	18,000	73,620.00	0.06
772	300171	东富龙	10,500	73,605.00	0.06
773	000701	厦门信达	12,000	72,720.00	0.06
774	603920	世运电路	6,100	72,651.00	0.06
775	002322	理工环科	8,000	72,640.00	0.06
776	002752	昇兴股份	10,000	72,500.00	0.06
777	300209	天泽信息	6,700	72,427.00	0.06
778	603612	索通发展	6,220	72,400.80	0.06
779	002930	宏川智慧	2,800	72,380.00	0.06
780	300100	双林股份	7,100	72,349.00	0.06
781	601789	宁波建工	23,300	72,230.00	0.06
782	300276	三丰智能	7,000	72,170.00	0.06
783	002418	康盛股份	23,400	72,072.00	0.06
784	300735	光弘科技	4,500	71,910.00	0.06
785	300304	云意电气	21,000	71,820.00	0.06
786	002733	雄韬股份	7,000	71,750.00	0.06
787	300527	中国应急	10,835	71,511.00	0.06
788	002178	延华智能	19,400	71,198.00	0.06
789	002658	雪迪龙	10,000	71,000.00	0.06
790	000056	皇庭国际	15,000	70,950.00	0.06
791	600278	东方创业	8,700	70,905.00	0.06
792	000561	烽火电子	12,600	70,686.00	0.06
793	600985	淮北矿业	7,600	70,680.00	0.06
794	002840	华统股份	5,400	70,578.00	0.06
795	600616	金枫酒业	14,800	70,448.00	0.06
796	603587	地素时尚	3,200	70,368.00	0.06
797	002518	科士达	9,770	70,344.00	0.06
798	600758	红阳能源	21,600	70,200.00	0.06
799	002196	方正电机	13,820	70,067.40	0.06

800	300263	隆华科技	17,500	70,000.00	0.06
801	300725	药石科技	1,300	69,979.00	0.06
802	000506	中润资源	26,000	69,940.00	0.06
803	002772	众兴菌业	10,800	69,876.00	0.06
804	300114	中航电测	9,800	69,776.00	0.06
805	300011	鼎汉技术	11,500	69,575.00	0.06
806	601137	博威合金	10,200	69,564.00	0.06
807	002631	德尔未来	10,800	69,552.00	0.06
808	300393	中来股份	4,600	69,368.00	0.06
809	002781	奇信股份	4,800	69,168.00	0.06
810	603693	江苏新能	5,000	68,950.00	0.06
811	002751	易尚展示	3,200	68,736.00	0.06
812	300441	鲍斯股份	10,040	68,071.20	0.06
813	300242	佳云科技	15,800	67,940.00	0.06
814	300008	天海防务	26,150	67,728.50	0.06
815	002329	皇氏集团	20,800	67,600.00	0.06
816	002346	柘中股份	5,400	67,500.00	0.06
817	002872	天圣制药	7,850	67,196.00	0.06
818	300504	天邑股份	2,600	66,976.00	0.06
819	002519	银河电子	19,180	66,938.20	0.06
820	600283	钱江水利	5,959	66,740.80	0.06
821	600173	卧龙地产	17,700	66,729.00	0.06
822	000905	厦门港务	11,000	66,660.00	0.06
823	603595	东尼电子	2,120	66,525.60	0.06
824	002850	科达利	3,600	66,420.00	0.05
825	000796	凯撒旅游	10,000	66,400.00	0.05
826	300140	中环装备	7,200	66,240.00	0.05
827	300625	三雄极光	4,700	66,129.00	0.05
828	002485	希努尔	8,700	66,033.00	0.05
829	000576	广东甘化	11,000	66,000.00	0.05
830	300737	科顺股份	7,500	65,850.00	0.05
831	002464	众应互联	7,560	65,772.00	0.05
832	603843	正平股份	8,400	65,520.00	0.05
833	300302	同有科技	8,800	65,384.00	0.05
834	002356	赫美集团	8,870	65,283.20	0.05
835	002432	九安医疗	12,700	65,278.00	0.05
836	300172	中电环保	12,500	65,250.00	0.05
837	002137	麦达数字	9,600	65,088.00	0.05
838	300520	科大国创	4,340	65,056.60	0.05
839	300465	高伟达	10,800	64,908.00	0.05
840	002530	金财互联	9,800	64,582.00	0.05
841	600279	重庆港九	16,500	64,515.00	0.05
842	601900	南方传媒	7,600	63,992.00	0.05

843	002053	云南能投	9,300	63,891.00	0.05
844	300194	福安药业	19,900	63,879.00	0.05
845	002158	汉钟精机	8,900	63,813.00	0.05
846	002590	万安科技	10,000	63,600.00	0.05
847	600146	商赢环球	9,600	63,168.00	0.05
848	002651	利君股份	15,400	62,986.00	0.05
849	000700	模塑科技	21,300	62,835.00	0.05
850	603126	中材节能	12,200	62,830.00	0.05
851	300350	华鹏飞	11,080	62,823.60	0.05
852	000018	神州长城	29,500	62,540.00	0.05
853	600501	航天晨光	10,300	62,521.00	0.05
854	600310	桂东电力	17,300	62,280.00	0.05
855	600207	安彩高科	14,200	61,628.00	0.05
856	002685	华东重机	12,500	61,500.00	0.05
857	300307	慈星股份	12,800	61,184.00	0.05
858	002143	印纪传媒	21,300	60,918.00	0.05
859	002246	北化股份	9,200	60,812.00	0.05
860	000011	深物业 A	6,600	60,588.00	0.05
861	603303	得邦照明	5,100	60,435.00	0.05
862	603997	继峰股份	7,900	60,435.00	0.05
863	002852	道道全	4,940	60,317.40	0.05
864	300221	银禧科技	11,700	60,255.00	0.05
865	600526	菲达环保	13,600	60,112.00	0.05
866	002071	长城影视	13,200	60,060.00	0.05
867	002822	中装建设	11,500	59,570.00	0.05
868	300328	宜安科技	9,700	59,558.00	0.05
869	000885	城发环境	8,300	59,511.00	0.05
870	603299	井神股份	11,600	59,508.00	0.05
871	600814	杭州解百	11,700	59,436.00	0.05
872	002742	三圣股份	7,200	59,328.00	0.05
873	002782	可立克	5,400	59,292.00	0.05
874	000517	荣安地产	25,500	58,905.00	0.05
875	603313	梦百合	2,800	58,828.00	0.05
876	603803	瑞斯康达	5,800	58,754.00	0.05
877	603730	岱美股份	2,800	58,492.00	0.05
878	603010	万盛股份	4,100	57,605.00	0.05
879	002232	启明信息	8,400	57,036.00	0.05
880	600876	洛阳玻璃	5,100	56,712.00	0.05
881	601500	通用股份	8,600	56,674.00	0.05
882	300278	华昌达	9,900	56,529.00	0.05
883	002574	明牌珠宝	11,200	55,216.00	0.05
884	601595	上海电影	4,500	55,035.00	0.05
885	002712	思美传媒	9,200	54,924.00	0.05



886	603466	风语筑	3,600	54,864.00	0.05
887	300378	鼎捷软件	5,600	54,824.00	0.05
888	002378	章源钨业	11,600	54,752.00	0.05
889	002401	中远海科	6,100	54,717.00	0.05
890	603777	来伊份	5,680	54,698.40	0.05
891	601015	陕西黑猫	10,300	54,693.00	0.05
892	002461	珠江啤酒	12,400	54,560.00	0.05
893	000838	财信发展	18,500	54,205.00	0.04
894	001896	豫能控股	17,500	53,375.00	0.04
895	600933	爱柯迪	6,900	52,854.00	0.04
896	600381	青海春天	9,200	52,808.00	0.04
897	603098	森特股份	3,860	52,766.20	0.04
898	603839	安正时尚	4,920	52,644.00	0.04
899	300109	新开源	3,818	52,497.50	0.04
900	603900	莱绅通灵	4,380	52,165.80	0.04
901	002605	姚记扑克	6,900	51,819.00	0.04
902	002788	鹭燕医药	4,100	51,742.00	0.04
903	603919	金徽酒	4,400	51,392.00	0.04
904	603218	日月股份	3,100	51,212.00	0.04
905	300173	智慧松德	11,300	51,189.00	0.04
906	600818	中路股份	4,800	50,880.00	0.04
907	300494	盛天网络	5,100	50,796.00	0.04
908	300682	朗新科技	3,100	50,685.00	0.04
909	600781	辅仁药业	4,000	50,600.00	0.04
910	300533	冰川网络	1,600	50,544.00	0.04
911	603058	永吉股份	5,300	50,403.00	0.04
912	300528	幸福蓝海	5,980	50,232.00	0.04
913	002895	川恒股份	4,200	50,232.00	0.04
914	603876	鼎胜新材	2,700	50,058.00	0.04
915	300468	四方精创	4,141	49,899.05	0.04
916	300440	运达科技	8,800	49,896.00	0.04
917	000626	远大控股	7,700	49,588.00	0.04
918	300511	雪榕生物	8,305	49,580.85	0.04
919	300447	全信股份	5,330	49,462.40	0.04
920	300426	唐德影视	7,250	49,445.00	0.04
921	300368	汇金股份	8,700	49,329.00	0.04
922	000514	渝开发	13,500	49,275.00	0.04
923	300664	鹏鹞环保	4,100	49,200.00	0.04
924	000533	万家乐	19,400	49,082.00	0.04
925	603103	横店影视	2,200	49,060.00	0.04
926	603779	威龙股份	3,700	49,025.00	0.04
927	601038	一拖股份	10,000	48,600.00	0.04
928	603626	科森科技	6,340	48,374.20	0.04

929	603579	荣泰健康	1,700	48,212.00	0.04
930	002918	蒙娜丽莎	2,900	48,140.00	0.04
931	603727	博迈科	3,900	48,126.00	0.04
932	600929	湖南盐业	5,800	47,734.00	0.04
933	603896	寿仙谷	1,800	47,646.00	0.04
934	603258	电魂网络	2,800	47,628.00	0.04
935	002901	大博医疗	1,600	47,344.00	0.04
936	603348	文灿股份	2,100	47,229.00	0.04
937	600828	茂业商业	10,008	46,937.52	0.04
938	603648	畅联股份	4,500	46,935.00	0.04
939	002577	雷柏科技	4,800	46,752.00	0.04
940	000722	湖南发展	7,700	46,431.00	0.04
941	002766	索菱股份	8,500	46,410.00	0.04
942	002534	杭锅股份	8,600	46,010.00	0.04
943	603801	志邦家居	1,900	45,619.00	0.04
944	002388	新亚制程	8,300	45,484.00	0.04
945	002351	漫步者	9,200	45,448.00	0.04
946	603063	禾望电气	7,200	45,432.00	0.04
947	603385	惠达卫浴	5,660	45,336.60	0.04
948	002759	天际股份	5,700	45,258.00	0.04
949	002287	奇正藏药	1,800	45,036.00	0.04
950	300613	富瀚微	500	44,990.00	0.04
951	603555	贵人鸟	7,600	43,852.00	0.04
952	603999	读者传媒	9,000	43,560.00	0.04
953	300660	江苏雷利	2,260	43,437.20	0.04
954	603055	台华新材	4,100	43,378.00	0.04
955	603817	海峡环保	7,200	43,272.00	0.04
956	300624	万兴科技	800	43,248.00	0.04
957	603358	华达科技	4,016	43,172.00	0.04
958	300160	秀强股份	12,500	43,125.00	0.04
959	300471	厚普股份	7,750	42,160.00	0.03
960	002911	佛燃股份	2,500	42,150.00	0.03
961	300512	中亚股份	3,500	42,000.00	0.03
962	603105	芯能科技	3,200	41,856.00	0.03
963	603861	白云电器	3,600	41,760.00	0.03
964	300516	久之洋	1,500	41,280.00	0.03
965	603666	亿嘉和	900	41,220.00	0.03
966	300432	富临精工	7,000	40,320.00	0.03
967	300484	蓝海华腾	3,600	40,284.00	0.03
968	002906	华阳集团	4,000	39,040.00	0.03
969	603773	沃格光电	900	38,952.00	0.03
970	603339	四方科技	2,600	38,870.00	0.03
971	300061	康旗股份	6,500	38,675.00	0.03

972	603421	鼎信通讯	1,800	38,394.00	0.03
973	603711	香飘飘	1,800	38,250.00	0.03
974	601619	嘉泽新能	8,000	37,200.00	0.03
975	603996	中新科技	4,900	36,946.00	0.03
976	002703	浙江世宝	8,800	36,872.00	0.03
977	300362	天翔环境	7,000	36,610.00	0.03
978	603557	起步股份	4,900	36,505.00	0.03
979	002377	国创高新	8,700	36,453.00	0.03
980	603180	金牌厨柜	600	34,812.00	0.03
981	300518	盛讯达	1,500	34,800.00	0.03
982	603363	傲农生物	4,100	34,440.00	0.03
983	002907	华森制药	1,800	33,912.00	0.03
984	603013	亚普股份	1,900	33,516.00	0.03
985	300634	彩讯股份	1,400	33,418.00	0.03
986	603081	大丰实业	2,800	32,564.00	0.03
987	300726	宏达电子	1,800	32,544.00	0.03
988	603165	荣晟环保	2,160	32,508.00	0.03
989	603733	仙鹤股份	2,100	32,382.00	0.03
990	603596	伯特利	1,400	32,018.00	0.03
991	603533	掌阅科技	1,800	32,004.00	0.03
992	601882	海天精工	4,300	30,272.00	0.03
993	603680	今创集团	1,900	30,001.00	0.02
994	603277	银都股份	3,400	29,784.00	0.02
995	002801	微光股份	1,400	29,722.00	0.02
996	603758	秦安股份	4,700	28,435.00	0.02
997	603619	中曼石油	1,800	27,936.00	0.02
998	603848	好太太	1,800	27,198.00	0.02
999	002928	华夏航空	1,400	26,194.00	0.02
1,000	603676	卫信康	2,000	22,540.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002680	*ST 长生	22,100	87,074.00	0.07
2	002102	ST 冠福	13,000	22,750.00	0.02

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300142	沃森生物	1,119,731.30	1.11
2	300176	鸿特科技	795,384.24	0.79
3	300347	泰格医药	788,029.00	0.78
4	300601	康泰生物	754,792.00	0.75
5	002821	凯莱英	715,313.00	0.71
6	002507	涪陵榨菜	699,332.00	0.69
7	000977	浪潮信息	677,936.00	0.67
8	300413	芒果超媒	607,309.00	0.60
9	300616	尚品宅配	594,422.00	0.59
10	300168	万达信息	536,163.24	0.53
11	300628	亿联网络	524,557.72	0.52
12	300558	贝达药业	504,012.00	0.50
13	000040	东旭蓝天	502,504.00	0.50
14	000735	罗牛山	472,781.00	0.47
15	300226	上海钢联	466,668.00	0.46
16	000697	炼石航空	464,329.00	0.46
17	300450	先导智能	456,984.00	0.45
18	300009	安科生物	442,251.00	0.44
19	300285	国瓷材料	441,503.46	0.44
20	002376	新北洋	438,909.00	0.43

1. 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；

2. 基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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。

#### 8.4.2 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	300142	沃森生物	1,602,682.00	1.59
2	300347	泰格医药	1,108,906.00	1.10
3	300413	芒果超媒	798,202.00	0.79
4	002507	涪陵榨菜	755,261.00	0.75
5	300450	先导智能	725,214.33	0.72
6	300168	万达信息	708,529.86	0.70
7	300316	晶盛机电	534,050.40	0.53
8	002372	伟星新材	533,866.60	0.53
9	600779	水井坊	501,605.60	0.50
10	000717	韶钢松山	464,578.00	0.46
11	600567	山鹰纸业	453,581.00	0.45
12	300616	尚品宅配	420,965.00	0.42
13	000735	罗牛山	411,737.00	0.41

14	300628	亿联网络	402,937.00	0.40
15	601699	潞安环能	375,697.38	0.37
16	002821	凯莱英	353,191.00	0.35
17	300418	昆仑万维	336,090.00	0.33
18	300226	上海钢联	334,881.00	0.33
19	002341	新纶科技	327,533.00	0.32
20	300285	国瓷材料	326,299.00	0.32

1、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；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	144,946,003.30
卖出股票收入（成交）总额	98,793,443.33

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

## 8.5 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。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1906	IC1906	2	1,613,040.00	-21,120.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-21,120.00
股指期货投资本期收益（元）					-641,000.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-59,360.00

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	268,822.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	904.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	269,727.08

#### 8.12.4 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债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002680	*ST 长生	87,074.00	0.07	重大事项停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,115	55,380.80	28,371,300.00	12.45%	199,520,700.00	87.55%	0.00	0.00%

本基金暂未发行对应的 ETF 联接基金。

### 9.2 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	中国人寿保险股份有限公司	12,000,000.00	5.27%
2	沈阳铁路局企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	6,920,200.00	3.04%
3	颜飞	6,310,300.00	2.77%

4	张改花	4,000,000.00	1.76%
5	方正证券股份有限公司	3,206,800.00	1.41%
6	钟宏庆	3,004,000.00	1.32%
7	张瑞华	2,501,900.00	1.10%
8	杨海锋	2,420,000.00	1.06%
9	福建天朗资产管理有限公司一天朗稳鑫一号私募证券投资基金	2,242,600.00	0.98%
10	张永劭	2,006,000.00	0.88%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年9月29日)基金份额总额	587,892,000.00
本报告期期初基金份额总额	122,892,000.00
本报告期基金总申购份额	258,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	153,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	227,892,000.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。



### 11.3 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，无涉及基金管理人的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 3 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 54,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	1	171,262,797.61	70.62%	17,129.79	70.62%	-
华泰证券	4	68,464,994.17	28.23%	6,848.09	28.23%	-
国信证券	1	2,786,249.53	1.15%	278.69	1.15%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 11.7.2 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
万联证券	86,250.26	81.84%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	19,139.20	18.16%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金增加国泰君安为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-02-08
2	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-02-28

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金证券投资基金 2018 年年度报告原文。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>