

南方中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 8 月 23 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 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	320,892,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

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	中国深圳深南大道 7088 号招商

	益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	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	证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,395,325.07
本期利润	25,740,297.58
加权平均基金份额本期利润	0.0919
本期加权平均净值利润率	14.14%
本期基金份额净值增长率	21.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-113,567,867.22
期末可供分配基金份额利润	-0.3539
期末基金资产净值	207,324,132.78
期末基金份额净值	0.6461
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-35.39%

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、对期末可供分配利润，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
过去一个月	0.29%	1.52%	-0.24%	1.52%	0.53%	0.00%
过去三个月	-8.92%	1.93%	-9.98%	1.94%	1.06%	-0.01%
过去六个月	21.81%	1.88%	20.12%	1.89%	1.69%	-0.01%
过去一年	-3.19%	1.76%	-5.12%	1.76%	1.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	-35.39%	1.40%	-38.07%	1.42%	2.68%	-0.02%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%。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）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职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；

3、本基金管理人于 2019 年 7 月 13 日发布公告，原基金经理周豪先生不在担任本基金基金经理，崔蕾女士为本基金新任基金经理。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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 指数上涨 20.12%。

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）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 根据指数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 0.6461 元，报告期内，份额净值增长率为 21.81%，同期业绩基准增长率为 20.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年经济运行总体平稳、稳中有进。随着 A 股国际化的持续推进，A 股市场先后被纳入 MSCI 和富时罗素指数，在北上资金持续流入和国内政策大力支持的背景下，A 股市场在年初完成了一轮估值修复行情，上半年中证 1000 指数上涨 20.12%。2019 年下半年，随着美联储降息，国内货币政策空间增大，在松紧适度的同时继续保持流动性合理充裕，利率环境的边际宽松有助于中小企业的反弹；财政政策加力提效，继续落实减税降费政策，支持中小企业发展。估值方面，目前 A 股市场整体估值适中，但中证 1000 指数估值仍处于历史低位，下半年估值仍有修复空间，投资者可关注中证 1000 的长期配置价值。总体而言，我们对下半年 A 股市场保持谨慎乐观的态度，关注机会的同时也要谨慎看待中美贸易摩擦、国内企业盈利恢复滞后和全球经济衰退等风险事件。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、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测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化

在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金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。

4.8 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,283,893.37	2,384,754.79
结算备付金		1,054,281.36	900,709.02
存出保证金		297,238.89	268,822.89
交易性金融资产	6.4.7.2	205,027,732.26	119,054,439.19
其中：股票投资		204,999,363.26	119,054,439.19
基金投资		-	-
债券投资		28,369.00	-
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		119,071.54	-
应收利息	6.4.7.5	1,598.06	904.19
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		210,783,815.48	122,609,630.08

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,369,093.10	1,005,902.86
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		79,681.19	53,691.48
应付托管费		15,936.23	10,738.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	29,322.78	14,206.63
应交税费		9,608.25	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	956,041.15	660,117.21
负债合计		3,459,682.70	1,744,656.49
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	320,892,000.00	227,892,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-113,567,867.22	-107,027,026.41
所有者权益合计		207,324,132.78	120,864,973.59
负债和所有者权益总计		210,783,815.48	122,609,630.08

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6461 元，基金份额总额 320,892,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至
----	-----	--	----------------------------

			2018 年 6 月 30 日
一、收入		26,816,974.49	-19,043,899.42
1. 利息收入		22,577.31	16,540.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,462.80	16,465.16
债券利息收入		114.51	75.75
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）		4,284,331.96	-5,090,109.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,584,918.76	-5,572,946.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,585.64	-3,589.69
资产支持证券投资	6.4.7.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	285,941.75	-152,520.00
股利收益	6.4.7.17	1,400,885.81	638,946.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	22,344,972.51	-14,107,665.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	165,092.71	137,335.02
减：二、费用		1,076,676.91	653,673.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	448,596.78	249,207.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	89,719.34	49,841.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	313,342.46	47,924.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-

支出			
6. 税金及附加		1,029.76	-
7. 其他费用	6.4.7.21	223,988.57	306,700.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,740,297.58	-19,697,572.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,740,297.58	-19,697,572.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	227,892,000.00	-107,027,026.41	120,864,973.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,740,297.58	25,740,297.58
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）	93,000,000.00	-32,281,138.39	60,718,861.61
其中：1. 基金申购款	492,000,000.00	-162,733,774.42	329,266,225.58
2. 基金赎回款	-399,000,000.00	130,452,636.03	-268,547,363.97
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）	320,892,000.00	-113,567,867.22	207,324,132.78

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.1.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,283,893.37
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	4,283,893.37

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	211,639,964.30	204,999,363.26	-6,640,601.04	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	22,000.00	28,369.00	6,369.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	22,000.00	28,369.00	6,369.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	211,661,964.30	205,027,732.26	-6,634,232.04	

注：于 2019 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2018 年 06 月 30 日：0.00 元)。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,822,280.00	-	-	-
股指期货	1,822,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,822,280.00	-	-	-

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	980.31
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	564.05
应收债券利息	21.60
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	32.10
合计	1,598.06

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	29,322.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	29,322.78

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应退退补款	786,459.46
预提费用	119,422.78
应付指数使用费	50,000.00
可退退补款	158.91
其他	-
合计	956,041.15

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。

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	227,892,000.00	227,892,000.00
本期申购	492,000,000.00	492,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-399,000,000.00	-399,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	320,892,000.00	320,892,000.00

6.4.3.10 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	-48,714,679.07	-58,312,347.34	-107,027,026.41
本期利润	3,395,325.07	22,344,972.51	25,740,297.58
本期基金份额交易产生的变动数	-20,572,759.37	-11,708,379.02	-32,281,138.39
其中：基金申购款	-102,055,208.09	-60,678,566.33	-162,733,774.42
基金赎回款	81,482,448.72	48,970,187.31	130,452,636.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-65,892,113.37	-47,675,753.85	-113,567,867.22

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,449.09
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	10,627.94
其他	385.77
合计	22,462.80

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	779,897.67
股票投资收益——赎回差价收入	1,805,021.09
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	2,584,918.76

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	221,053,296.71
减：卖出股票成本总额	220,273,399.04
买卖股票差价收入	779,897.67

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	268,547,363.97
减：现金支付赎回款总额	173,916,913.97
减：赎回股票成本总额	92,825,428.91
赎回差价收入	1,805,021.09

6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	211,581.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	198,900.00
减：应收利息总额	95.89
买卖债券差价收入	12,585.64

6.4.3.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.15 贵金属投资收益

6.4.3.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.16 衍生工具收益

6.4.3.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	285,941.75

6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,400,885.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,400,885.81

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	22,264,132.51
——股票投资	22,257,763.51
——债券投资	6,369.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	80,840.00
——权证投资	-
——期货投资	80,840.00
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	22,344,972.51

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2018 上半年度：0.00 元)。

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	165,092.71
合计	165,092.71

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。

6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	313,342.46
银行间市场交易费用	-
合计	313,342.46

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,917.22
指数使用费	100,000.00
银行费用	4,565.79
上市费	29,752.78
合计	223,988.57

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。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司新增厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）四名股东，股权结构发生变更。基金管理人已于 2019 年 8 月 1 日发布相关公告。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.6.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	71,947,245.96	14.74%	26,952,483.09	33.94%

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	7,194.83	14.74%	5,909.75	20.15%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	2,690.09	33.90%	2,384.70	55.20%

注：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。

6.4.6.2 关联方报酬**6.4.6.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	448,596.78	249,207.44
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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：

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	89,719.34	49,841.48

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：

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

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 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

无。

6.4.6.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

招商银行	4,283,893.37	11,449.09	2,355,815.60	7,991.20
------	--------------	-----------	--------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
600480	凌云股份	2019年6月20日	2019年7月3日	增发未上市	8.74	8.75	4,290	37,494.60	37,537.50	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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同责任，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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01% (2018 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

6.4.9.3 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 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 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 6.4.12。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 2019 年 6 月 30 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 0.05%。

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。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	4,283,893.37	-	-	-	4,283,893.37
结算备付金	1,054,281.36	-	-	-	1,054,281.36
存出保证金	71,398.89	-	-	225,840.00	297,238.89
交易性金融资产	-	-	28,369.00	204,999,363.26	205,027,732.26
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,598.06	1,598.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	119,071.54	119,071.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,409,573.62	-	28,369.00	205,345,872.	210,783,815.

				86	48
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	79,681.19	79,681.19
应付托管费	-	-	-	15,936.23	15,936.23
应付证券清算款	-	-	-	2,369,093.10	2,369,093.10
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	29,322.78	29,322.78
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9,608.25	9,608.25
其他负债	-	-	-	956,041.15	956,041.15
负债总计	-	-	-	3,459,682.70	3,459,682.70
利率敏感度缺口	5,409,573.62	-	28,369.00	201,886,190.16	207,324,132.78
上年度末 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	-	-	-	53,691.48	53,691.48

报酬					
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

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 06 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%(2018 年 12 月 31 日:0.00%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日:同)。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末无外汇风险的敏感性分析。

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法,跟踪中证 1000 指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中,中证 1000 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外,

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	204,999,363.26	98.88	119,054,439.19	98.50
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	204,999,363.26	98.88	119,054,439.19	98.50

其他包含股指期货投资，于 2019 年 6 月 30 日，持仓数量为 2 手，合约市值为 1,882,000.00。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。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	10,228,336.09	6,001,550.26
2.组合自身基准下降 5%	-10,228,336.09	-6,001,550.26	

§ 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（元）	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	204,999,363.26	97.26

	其中：股票	204,999,363.26	97.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,369.00	0.01
	其中：债券	28,369.00	0.01
	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	5,338,174.73	2.53
8	其他资产	417,908.49	0.20
9	合计	210,783,815.48	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,462,770.70	1.19
B	采矿业	4,196,841.24	2.02
C	制造业	125,515,929.94	60.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,542,774.39	2.67
E	建筑业	5,621,645.75	2.71
F	批发和零售业	7,124,785.94	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	4,540,821.92	2.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,268,228.33	11.71
J	金融业	1,491,563.60	0.72
K	房地产业	8,134,332.54	3.92
L	租赁和商务服务业	1,942,155.70	0.94
M	科学研究和技术服务业	3,757,977.38	1.81
N	水利、环境和公共设施管理业	2,938,496.20	1.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	390,453.00	0.19
Q	卫生和社会工作	2,537,962.00	1.22
R	文化、体育和娱乐业	2,789,315.36	1.35
S	综合	1,350,690.00	0.65
	合计	204,606,743.99	98.69

7.2.2 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	117,416.25	0.06
C	制造业	172,083.56	0.08
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	6,539.16	0.00
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	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	392,619.27	0.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

7.3.1 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

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	300347	泰格医药	21,900	1,688,490.00	0.81
2	300014	亿纬锂能	26,576	809,504.96	0.39
3	300012	华测检测	72,500	783,000.00	0.38
4	600728	佳都科技	70,600	695,410.00	0.34
5	600635	大众公用	105,800	679,236.00	0.33
6	300285	国瓷材料	37,000	629,370.00	0.30
7	600132	重庆啤酒	13,300	627,228.00	0.30
8	002138	顺络电子	35,300	620,574.00	0.30
9	600776	东方通信	26,200	602,076.00	0.29

10	601799	星宇股份	7,600	600,096.00	0.29
11	300271	华宇软件	31,000	589,000.00	0.28
12	600797	浙大网新	57,800	588,982.00	0.28
13	002124	天邦股份	44,650	582,236.00	0.28
14	600873	梅花生物	118,600	568,094.00	0.27
15	600446	金证股份	28,100	551,884.00	0.27
16	600273	嘉化能源	47,500	549,100.00	0.26
17	300098	高新兴	68,020	542,799.60	0.26
18	300628	亿联网络	4,900	524,643.00	0.25
19	300170	汉得信息	38,500	523,215.00	0.25
20	600675	中华企业	100,580	522,010.20	0.25
21	000831	五矿稀土	32,030	519,846.90	0.25
22	600529	山东药玻	22,724	517,652.72	0.25
23	600604	市北高新	38,100	505,968.00	0.24
24	002237	恒邦股份	30,000	501,300.00	0.24
25	000735	罗牛山	50,500	498,435.00	0.24
26	300357	我武生物	14,360	487,091.20	0.23
27	600305	恒顺醋业	25,800	475,236.00	0.23
28	002185	华天科技	93,200	474,388.00	0.23
29	300188	美亚柏科	26,380	470,355.40	0.23
30	002035	华帝股份	38,200	465,276.00	0.22
31	300226	上海钢联	6,100	457,256.00	0.22
32	300558	贝达药业	10,900	452,350.00	0.22
33	300079	数码科技	78,900	448,941.00	0.22
34	603338	浙江鼎力	7,608	446,665.68	0.22
35	002511	中顺洁柔	36,195	444,474.60	0.21
36	600252	中恒集团	151,400	443,602.00	0.21
37	000800	一汽轿车	44,800	440,832.00	0.21
38	002123	梦网集团	31,100	439,754.00	0.21
39	000516	国际医学	86,000	436,880.00	0.21
40	300212	易华录	17,800	436,100.00	0.21
41	000917	电广传媒	62,000	435,860.00	0.21
42	300180	华峰超纤	31,040	435,180.80	0.21
43	300339	润和软件	30,600	431,460.00	0.21
44	300529	健帆生物	6,900	430,215.00	0.21
45	002648	卫星石化	28,900	430,032.00	0.21
46	600756	浪潮软件	17,800	425,776.00	0.21
47	600323	瀚蓝环境	25,200	425,376.00	0.21
48	002396	星网锐捷	18,900	424,116.00	0.20
49	300038	数知科技	45,200	423,072.00	0.20
50	002547	春兴精工	37,100	416,262.00	0.20
51	300203	聚光科技	17,400	415,860.00	0.20
52	600601	方正科技	119,700	414,162.00	0.20

53	600320	振华重工	108,580	408,260.80	0.20
54	002023	海特高新	33,300	407,592.00	0.20
55	000683	远兴能源	150,100	391,761.00	0.19
56	600868	梅雁吉祥	103,800	390,288.00	0.19
57	000902	新 洋 丰	36,100	387,353.00	0.19
58	600206	有研新材	32,300	385,985.00	0.19
59	000967	盈峰环境	51,990	384,726.00	0.19
60	300463	迈克生物	15,300	384,489.00	0.19
61	300496	中科创达	13,200	383,856.00	0.19
62	600559	老白干酒	29,204	382,280.36	0.18
63	000040	东旭蓝天	57,400	381,136.00	0.18
64	600711	盛屯矿业	70,400	380,864.00	0.18
65	000591	太 阳 能	114,940	377,003.20	0.18
66	002099	海翔药业	53,000	376,300.00	0.18
67	601011	宝 泰 隆	61,700	375,753.00	0.18
68	002413	雷科防务	58,700	375,093.00	0.18
69	002151	北斗星通	16,100	374,003.00	0.18
70	300699	光威复材	11,420	373,434.00	0.18
71	000968	蓝焰控股	31,700	368,037.00	0.18
72	000560	我爱我家	76,930	367,725.40	0.18
73	000667	美好置业	139,700	367,411.00	0.18
74	002610	爱康科技	196,200	366,894.00	0.18
75	002467	二 六 三	59,480	365,207.20	0.18
76	002020	京新药业	31,700	365,184.00	0.18
77	002042	华孚时尚	50,000	363,000.00	0.18
78	600771	广 誉 远	18,620	361,228.00	0.17
79	002449	国星光电	27,150	360,552.00	0.17
80	600490	鹏欣资源	72,900	360,126.00	0.17
81	300451	创业慧康	23,900	357,305.00	0.17
82	300118	东方日升	34,800	354,264.00	0.17
83	002727	一 心 堂	12,400	353,276.00	0.17
84	300567	精测电子	6,700	351,884.00	0.17
85	600667	太极实业	46,500	351,075.00	0.17
86	002557	洽洽食品	13,900	350,975.00	0.17
87	600702	舍得酒业	12,900	350,622.00	0.17
88	002402	和 而 泰	36,950	349,916.50	0.17
89	300630	普利制药	6,069	349,695.78	0.17
90	600803	新奥股份	33,400	349,030.00	0.17
91	600621	华鑫股份	23,400	348,426.00	0.17
92	600677	航天通信	20,000	347,400.00	0.17
93	000650	仁和药业	48,000	346,080.00	0.17
94	002203	海亮股份	31,900	345,158.00	0.17
95	002025	航天电器	14,100	343,758.00	0.17

96	600366	宁波韵升	37,400	343,332.00	0.17
97	000710	贝瑞基因	9,600	342,336.00	0.17
98	601636	旗滨集团	87,800	341,542.00	0.16
99	600330	天通股份	43,340	340,652.40	0.16
100	600708	光明地产	61,004	340,402.32	0.16
101	300352	北信源	55,100	339,967.00	0.16
102	300369	绿盟科技	26,300	336,903.00	0.16
103	000059	华锦股份	52,400	335,360.00	0.16
104	600422	昆药集团	29,000	334,370.00	0.16
105	600596	新安股份	30,900	332,484.00	0.16
106	600988	赤峰黄金	54,300	332,316.00	0.16
107	600503	华丽家族	87,300	331,740.00	0.16
108	300073	当升科技	14,400	330,768.00	0.16
109	002597	金禾实业	18,100	330,144.00	0.16
110	300616	尚品宅配	4,340	328,190.80	0.16
111	600226	瀚叶股份	103,194	328,156.92	0.16
112	600185	格力地产	67,200	327,264.00	0.16
113	600284	浦东建设	42,400	326,480.00	0.16
114	601588	北辰实业	86,900	325,875.00	0.16
115	000697	炼石航空	29,000	325,380.00	0.16
116	002126	银轮股份	43,600	324,384.00	0.16
117	300367	东方网力	32,800	323,736.00	0.16
118	300068	南都电源	28,500	322,050.00	0.16
119	603368	柳药股份	9,792	321,960.96	0.16
120	300294	博雅生物	11,850	321,727.50	0.16
121	002436	兴森科技	49,100	321,605.00	0.16
122	002446	盛路通信	33,610	320,303.30	0.15
123	002488	金固股份	38,400	319,872.00	0.15
124	002063	远光软件	36,700	319,657.00	0.15
125	000035	中国天楹	53,200	319,200.00	0.15
126	000799	酒鬼酒	12,600	318,150.00	0.15
127	600072	中船科技	24,500	317,030.00	0.15
128	603707	健友股份	8,950	316,382.50	0.15
129	300078	思创医惠	30,920	315,693.20	0.15
130	000739	普洛药业	32,100	315,543.00	0.15
131	601222	林洋能源	67,200	315,168.00	0.15
132	300595	欧普康视	8,840	314,704.00	0.15
133	603658	安图生物	4,600	314,456.00	0.15
134	300618	寒锐钴业	5,240	314,400.00	0.15
135	600562	国睿科技	20,410	313,497.60	0.15
136	000921	海信家电	25,100	313,248.00	0.15
137	600612	老凤祥	7,000	312,900.00	0.15
138	002567	唐人神	27,050	312,427.50	0.15

139	601375	中原证券	58,800	311,052.00	0.15
140	603128	华贸物流	33,000	310,200.00	0.15
141	600936	广西广电	63,900	309,915.00	0.15
142	603708	家家悦	13,562	309,484.84	0.15
143	600641	万业企业	26,100	308,502.00	0.15
144	601519	大智慧	43,400	307,706.00	0.15
145	601058	赛轮轮胎	103,600	307,692.00	0.15
146	002458	益生股份	15,740	307,087.40	0.15
147	000070	特发信息	25,040	306,239.20	0.15
148	600736	苏州高新	37,300	305,860.00	0.15
149	002376	新北洋	25,500	304,725.00	0.15
150	600459	贵研铂业	16,806	303,684.42	0.15
151	002643	万润股份	29,950	302,495.00	0.15
152	002481	双塔食品	40,900	302,251.00	0.15
153	300401	花园生物	18,100	300,641.00	0.15
154	603678	火炬电子	14,900	300,235.00	0.14
155	002073	软控股份	51,100	298,424.00	0.14
156	000875	吉电股份	93,800	298,284.00	0.14
157	600850	华东电脑	14,000	298,060.00	0.14
158	603660	苏州科达	19,072	297,332.48	0.14
159	002262	恩华药业	27,540	297,156.60	0.14
160	300054	鼎龙股份	37,280	296,376.00	0.14
161	600720	祁连山	33,700	296,223.00	0.14
162	000901	航天科技	23,800	296,072.00	0.14
163	600108	亚盛集团	84,900	295,452.00	0.14
164	002531	天顺风能	48,900	295,356.00	0.14
165	600175	美都能源	117,100	295,092.00	0.14
166	000592	平潭发展	84,300	295,050.00	0.14
167	300292	吴通控股	49,100	294,600.00	0.14
168	000989	九芝堂	33,100	294,590.00	0.14
169	300476	胜宏科技	26,060	294,478.00	0.14
170	300747	锐科激光	2,100	294,021.00	0.14
171	002497	雅化集团	42,000	293,580.00	0.14
172	000851	高鸿股份	49,880	293,294.40	0.14
173	300284	苏交科	31,756	293,107.88	0.14
174	600624	复旦复华	26,300	292,982.00	0.14
175	000836	富通鑫茂	65,800	292,810.00	0.14
176	300036	超图软件	19,800	292,644.00	0.14
177	000793	华闻传媒	87,000	292,320.00	0.14
178	002675	东诚药业	26,700	291,564.00	0.14
179	002716	金贵银业	37,370	291,486.00	0.14
180	600546	山煤国际	54,000	290,520.00	0.14
181	002389	航天彩虹	25,900	289,044.00	0.14

182	000036	华联控股	56,550	288,970.50	0.14
183	600783	鲁信创投	16,300	288,836.00	0.14
184	600483	福能股份	33,700	288,472.00	0.14
185	601929	吉视传媒	118,700	288,441.00	0.14
186	600491	龙元建设	41,800	288,420.00	0.14
187	300149	量子生物	18,900	286,335.00	0.14
188	300326	凯利泰	31,600	285,980.00	0.14
189	600093	易见股份	24,900	285,105.00	0.14
190	600326	西藏天路	37,420	284,392.00	0.14
191	002400	省广集团	95,300	283,994.00	0.14
192	600269	赣粤高速	63,700	282,828.00	0.14
193	300482	万孚生物	7,502	282,825.40	0.14
194	002383	合众思壮	24,800	281,728.00	0.14
195	603043	广州酒家	8,700	281,271.00	0.14
196	002618	丹邦科技	20,950	280,939.50	0.14
197	600740	山西焦化	33,000	280,170.00	0.14
198	300377	赢时胜	24,750	280,170.00	0.14
199	000818	航锦科技	26,300	280,095.00	0.14
200	002234	民和股份	10,000	279,900.00	0.14
201	600197	伊力特	14,500	279,850.00	0.13
202	600110	诺德股份	62,800	278,204.00	0.13
203	300185	通裕重工	143,400	278,196.00	0.13
204	600337	美克家居	67,402	277,696.24	0.13
205	300085	银之杰	19,500	276,705.00	0.13
206	002168	惠程科技	31,200	276,120.00	0.13
207	603323	吴江银行	49,490	274,174.60	0.13
208	600360	华微电子	42,200	273,878.00	0.13
209	600602	云赛智联	35,700	273,819.00	0.13
210	300145	中金环境	63,060	273,680.40	0.13
211	002867	周大生	8,000	273,520.00	0.13
212	000900	现代投资	58,600	273,076.00	0.13
213	300666	江丰电子	7,200	273,024.00	0.13
214	002912	中新赛克	2,900	272,223.00	0.13
215	000733	振华科技	16,500	271,920.00	0.13
216	600217	中再资环	37,600	271,848.00	0.13
217	002421	达实智能	72,800	271,544.00	0.13
218	600456	宝钛股份	11,900	271,439.00	0.13
219	000672	上峰水泥	22,100	271,167.00	0.13
220	600123	兰花科创	37,000	270,840.00	0.13
221	002429	兆驰股份	98,600	270,164.00	0.13
222	000958	东方能源	42,100	269,440.00	0.13
223	002683	宏大爆破	23,000	269,100.00	0.13
224	600517	置信电气	36,743	268,958.76	0.13

225	600761	安徽合力	28,000	268,800.00	0.13
226	601666	平煤股份	64,300	268,774.00	0.13
227	600210	紫江企业	66,000	267,300.00	0.13
228	000789	万年青	26,670	267,233.40	0.13
229	002156	通富微电	31,500	267,120.00	0.13
230	600067	冠城大通	56,700	267,057.00	0.13
231	600057	厦门象屿	59,246	263,644.70	0.13
232	300053	欧比特	26,400	263,472.00	0.13
233	300037	新宙邦	12,600	262,584.00	0.13
234	000933	神火股份	62,300	262,283.00	0.13
235	000918	嘉凯城	39,700	262,020.00	0.13
236	300184	力源信息	25,820	261,814.80	0.13
237	000936	华西股份	29,300	261,649.00	0.13
238	000546	金圆股份	27,100	261,244.00	0.13
239	601918	新集能源	84,800	261,184.00	0.13
240	600502	安徽水利	56,100	260,865.00	0.13
241	600363	联创光电	19,500	260,520.00	0.13
242	300222	科大智能	20,000	260,400.00	0.13
243	002097	山河智能	41,657	259,939.68	0.13
244	600020	中原高速	49,400	259,350.00	0.13
245	600116	三峡水利	32,400	258,552.00	0.12
246	002851	麦格米特	13,050	257,998.50	0.12
247	002657	中科金财	14,800	257,520.00	0.12
248	002649	博彦科技	28,900	257,499.00	0.12
249	002326	永太科技	31,401	257,488.20	0.12
250	603882	金域医学	7,500	257,250.00	0.12
251	000016	深康佳 A	61,200	257,040.00	0.12
252	603345	安井食品	5,000	257,000.00	0.12
253	002139	拓邦股份	44,300	256,940.00	0.12
254	300457	赢合科技	10,250	255,532.50	0.12
255	002717	岭南股份	50,635	255,200.40	0.12
256	002537	海联金汇	33,840	255,153.60	0.12
257	002596	海南瑞泽	31,500	254,520.00	0.12
258	002430	杭氧股份	21,100	254,466.00	0.12
259	000996	中国中期	18,650	254,199.50	0.12
260	603018	中设集团	20,400	253,980.00	0.12
261	002568	百润股份	14,200	253,896.00	0.12
262	002130	沃尔核材	48,700	253,727.00	0.12
263	300310	宜通世纪	34,040	253,257.60	0.12
264	002145	中核钛白	61,100	252,343.00	0.12
265	300355	蒙草生态	61,540	252,314.00	0.12
266	300137	先河环保	30,220	251,732.60	0.12
267	002614	奥佳华	15,400	251,328.00	0.12

268	300379	东方通	12,300	250,920.00	0.12
269	300349	金卡智能	14,100	250,698.00	0.12
270	300130	新国都	15,740	250,266.00	0.12
271	600577	精达股份	82,500	249,975.00	0.12
272	002036	联创电子	27,300	249,795.00	0.12
273	600331	宏达股份	77,400	248,454.00	0.12
274	600512	腾达建设	87,100	248,235.00	0.12
275	600986	科达股份	58,580	247,793.40	0.12
276	601369	陕鼓动力	37,200	246,636.00	0.12
277	002737	葵花药业	16,000	246,240.00	0.12
278	300232	洲明科技	25,434	246,201.12	0.12
279	002047	宝鹰股份	43,800	245,718.00	0.12
280	603039	泛微网络	3,308	245,453.60	0.12
281	000976	华铁股份	43,500	245,340.00	0.12
282	002080	中材科技	27,076	245,308.56	0.12
283	002313	日海智能	12,100	244,420.00	0.12
284	300725	药石科技	3,910	243,710.30	0.12
285	002091	江苏国泰	42,630	243,417.30	0.12
286	300176	鸿特科技	16,540	243,138.00	0.12
287	600764	中国海防	8,700	242,556.00	0.12
288	600990	四创电子	5,200	241,904.00	0.12
289	300322	硕贝德	15,600	241,800.00	0.12
290	600622	光大嘉宝	49,541	241,264.67	0.12
291	603718	海利生物	17,300	239,951.00	0.12
292	000726	鲁泰 A	25,000	239,000.00	0.12
293	000555	神州信息	21,000	238,980.00	0.12
294	603027	千禾味业	10,000	238,700.00	0.12
295	600846	同济科技	26,900	238,603.00	0.12
296	600851	海欣股份	32,200	238,602.00	0.12
297	600668	尖峰集团	18,600	238,080.00	0.11
298	600981	汇鸿集团	49,400	237,614.00	0.11
299	002697	红旗连锁	36,700	237,449.00	0.11
300	000582	北部湾港	26,300	236,700.00	0.11
301	603026	石大胜华	7,800	236,028.00	0.11
302	600531	豫光金铅	47,100	235,971.00	0.11
303	000951	中国重汽	14,700	235,935.00	0.11
304	600742	一汽富维	22,060	235,380.20	0.11
305	002171	楚江新材	37,000	235,320.00	0.11
306	002292	奥飞娱乐	36,600	234,606.00	0.11
307	600200	江苏吴中	39,700	233,436.00	0.11
308	600105	永鼎股份	48,340	232,998.80	0.11
309	603588	高能环境	21,800	232,606.00	0.11
310	600477	杭萧钢构	70,700	231,896.00	0.11

311	300238	冠昊生物	11,500	231,610.00	0.11
312	000088	盐田港	42,400	231,504.00	0.11
313	001696	宗申动力	37,100	231,133.00	0.11
314	300208	青岛中程	29,500	230,985.00	0.11
315	300300	汉鼎宇佑	22,250	230,955.00	0.11
316	601677	明泰铝业	22,400	230,944.00	0.11
317	000882	华联股份	90,500	230,775.00	0.11
318	300047	天源迪科	27,559	230,668.83	0.11
319	603399	吉翔股份	20,500	230,625.00	0.11
320	600059	古越龙山	26,000	230,360.00	0.11
321	300102	乾照光电	39,500	230,285.00	0.11
322	002370	亚太药业	14,500	229,100.00	0.11
323	300348	长亮科技	15,800	229,100.00	0.11
324	002550	千红制药	49,300	228,752.00	0.11
325	603686	龙马环卫	11,500	228,620.00	0.11
326	300177	中海达	26,150	228,028.00	0.11
327	000034	神州数码	17,600	227,040.00	0.11
328	600162	香江控股	93,000	226,920.00	0.11
329	600129	太极集团	21,300	224,289.00	0.11
330	002022	科华生物	22,400	224,224.00	0.11
331	600966	博汇纸业	58,800	224,028.00	0.11
332	603599	广信股份	15,256	223,805.52	0.11
333	002104	恒宝股份	31,116	223,724.04	0.11
334	002261	拓维信息	36,600	223,626.00	0.11
335	000795	英洛华	31,000	223,200.00	0.11
336	000507	珠海港	36,100	222,737.00	0.11
337	600789	鲁抗医药	33,430	222,643.80	0.11
338	600496	精工钢构	69,700	220,949.00	0.11
339	600285	羚锐制药	26,200	220,866.00	0.11
340	002564	天沃科技	38,100	220,218.00	0.11
341	002428	云南锗业	28,800	219,744.00	0.11
342	002100	天康生物	27,100	219,510.00	0.11
343	000550	江铃汽车	11,300	219,107.00	0.11
344	300365	恒华科技	13,500	218,835.00	0.11
345	002522	浙江众成	29,100	218,541.00	0.11
346	002117	东港股份	20,900	218,405.00	0.11
347	603605	珀莱雅	3,300	218,394.00	0.11
348	300101	振芯科技	21,300	218,325.00	0.11
349	000751	锌业股份	61,700	217,801.00	0.11
350	002182	云海金属	28,600	217,646.00	0.10
351	600495	晋西车轴	45,900	217,566.00	0.10
352	000429	粤高速 A	28,800	217,440.00	0.10
353	002276	万马股份	39,800	216,910.00	0.10

354	002498	汉缆股份	72,800	215,488.00	0.10
355	300353	东土科技	16,500	215,160.00	0.10
356	600300	维维股份	64,100	214,735.00	0.10
357	600343	航天动力	20,900	214,225.00	0.10
358	601069	西部黄金	13,900	214,060.00	0.10
359	300685	艾德生物	4,080	213,669.60	0.10
360	000043	中航善达	18,000	213,300.00	0.10
361	300123	亚光科技	27,060	213,232.80	0.10
362	000903	云内动力	75,300	213,099.00	0.10
363	002115	三维通信	17,900	212,652.00	0.10
364	300131	英唐智控	40,100	212,530.00	0.10
365	002041	登海种业	19,400	212,236.00	0.10
366	300044	赛为智能	29,320	211,690.40	0.10
367	002663	普邦股份	69,700	211,191.00	0.10
368	002222	福晶科技	18,900	211,113.00	0.10
369	300205	天喻信息	14,100	210,936.00	0.10
370	000915	山大华特	10,310	210,839.50	0.10
371	002215	诺普信	30,100	210,700.00	0.10
372	002108	沧州明珠	53,989	210,557.10	0.10
373	600997	开滦股份	34,400	210,528.00	0.10
374	000810	创维数字	23,800	210,392.00	0.10
375	002067	景兴纸业	61,000	209,840.00	0.10
376	000666	经纬纺机	16,800	209,160.00	0.10
377	603508	思维列控	3,200	208,256.00	0.10
378	000603	盛达矿业	18,600	207,948.00	0.10
379	300236	上海新阳	6,400	207,616.00	0.10
380	002474	榕基软件	24,100	207,019.00	0.10
381	300406	九强生物	13,700	206,596.00	0.10
382	000828	东莞控股	22,500	206,325.00	0.10
383	600063	皖维高新	73,600	206,080.00	0.10
384	300020	银江股份	25,500	205,530.00	0.10
385	300183	东软载波	13,100	205,408.00	0.10
386	002621	美吉姆	15,700	205,356.00	0.10
387	300233	金城医药	10,800	204,336.00	0.10
388	600420	现代制药	22,900	204,268.00	0.10
389	000935	四川双马	12,700	203,073.00	0.10
390	600400	红豆股份	55,620	203,013.00	0.10
391	002192	融捷股份	10,000	203,000.00	0.10
392	603108	润达医疗	19,180	202,924.40	0.10
393	600790	轻纺城	55,800	202,554.00	0.10
394	002267	陕天然气	24,700	202,293.00	0.10
395	300456	耐威科技	7,400	202,020.00	0.10
396	002303	美盈森	41,800	201,894.00	0.10

397	002425	凯撒文化	31,160	201,605.20	0.10
398	000801	四川九洲	33,300	201,465.00	0.10
399	002031	巨轮智能	95,900	201,390.00	0.10
400	300091	金通灵	40,480	201,185.60	0.10
401	002698	博实股份	22,250	201,140.00	0.10
402	002235	安妮股份	22,900	200,833.00	0.10
403	000676	智度股份	22,200	200,244.00	0.10
404	300495	美尚生态	14,750	200,157.50	0.10
405	002167	东方锆业	26,700	199,983.00	0.10
406	002746	仙坛股份	12,915	199,795.05	0.10
407	603113	金能科技	18,100	199,462.00	0.10
408	000910	大亚圣象	17,900	199,406.00	0.10
409	002301	齐心集团	17,200	199,348.00	0.10
410	002307	北新路桥	29,640	199,180.80	0.10
411	002721	金一文化	32,000	199,040.00	0.10
412	002318	久立特材	27,200	198,832.00	0.10
413	002309	中利集团	28,900	198,832.00	0.10
414	000957	中通客车	26,500	198,750.00	0.10
415	600308	华泰股份	44,400	198,024.00	0.10
416	002705	新宝股份	17,200	197,800.00	0.10
417	000928	中钢国际	34,000	197,540.00	0.10
418	300474	景嘉微	5,000	197,300.00	0.10
419	002367	康力电梯	26,700	197,046.00	0.10
420	600146	商赢环球	13,100	196,762.00	0.09
421	603118	共进股份	21,200	196,312.00	0.09
422	600133	东湖高新	31,100	196,241.00	0.09
423	000688	国城矿业	18,400	196,144.00	0.09
424	600987	航民股份	29,665	196,085.65	0.09
425	601890	亚星锚链	31,400	195,936.00	0.09
426	601949	中国出版	30,000	195,000.00	0.09
427	002228	合兴包装	38,700	194,661.00	0.09
428	002733	雄韬股份	9,600	194,112.00	0.09
429	600812	华北制药	44,300	193,591.00	0.09
430	600626	申达股份	28,300	193,572.00	0.09
431	002585	双星新材	38,220	193,393.20	0.09
432	002095	生意宝	8,100	193,266.00	0.09
433	002003	伟星股份	28,500	192,660.00	0.09
434	002798	帝欧家居	10,500	192,255.00	0.09
435	600391	航发科技	12,900	192,081.00	0.09
436	002258	利尔化学	14,700	191,835.00	0.09
437	002206	海利得	46,350	191,425.50	0.09
438	300502	新易盛	7,800	191,256.00	0.09
439	002677	浙江美大	14,500	190,820.00	0.09

440	600658	电子城	37,300	190,603.00	0.09
441	603318	派思股份	8,600	190,060.00	0.09
442	002447	晨鑫科技	55,600	189,596.00	0.09
443	601908	京运通	54,300	189,507.00	0.09
444	600230	沧州大化	13,880	189,462.00	0.09
445	000811	冰轮环境	21,400	188,962.00	0.09
446	000520	长航凤凰	55,000	188,650.00	0.09
447	300633	开立医疗	6,600	188,496.00	0.09
448	300031	宝通科技	15,200	187,872.00	0.09
449	000889	中嘉博创	14,700	187,719.00	0.09
450	601700	风范股份	31,000	187,240.00	0.09
451	000731	四川美丰	32,200	187,082.00	0.09
452	002515	金字火腿	32,160	186,849.60	0.09
453	002859	洁美科技	7,100	186,730.00	0.09
454	002135	东南网架	33,700	186,698.00	0.09
455	300299	富春股份	27,495	186,416.10	0.09
456	600963	岳阳林纸	38,500	186,340.00	0.09
457	600255	梦舟股份	96,500	186,245.00	0.09
458	002298	中电兴发	26,300	186,204.00	0.09
459	300458	全志科技	8,908	186,177.20	0.09
460	300194	福安药业	32,600	186,146.00	0.09
461	600096	云天化	31,200	185,952.00	0.09
462	600590	泰豪科技	28,710	185,753.70	0.09
463	002219	恒康医疗	61,300	185,739.00	0.09
464	300034	钢研高纳	12,500	185,500.00	0.09
465	300158	振东制药	34,200	185,364.00	0.09
466	300303	聚飞光电	56,000	185,360.00	0.09
467	603638	艾迪精密	8,232	185,220.00	0.09
468	600661	昂立教育	7,900	185,097.00	0.09
469	002226	江南化工	34,400	185,072.00	0.09
470	300081	恒信东方	14,900	185,058.00	0.09
471	603609	禾丰牧业	15,600	184,704.00	0.09
472	002668	奥马电器	35,656	184,698.08	0.09
473	603881	数据港	5,800	184,556.00	0.09
474	300237	美晨生态	46,860	184,159.80	0.09
475	002341	新纶科技	31,500	183,960.00	0.09
476	600569	安阳钢铁	62,800	183,376.00	0.09
477	300045	华力创通	20,500	183,270.00	0.09
478	600636	三爱富	16,700	183,199.00	0.09
479	300039	上海凯宝	41,100	182,895.00	0.09
480	601116	三江购物	12,000	182,880.00	0.09
481	601886	江河集团	25,700	182,727.00	0.09
482	600351	亚宝药业	29,700	182,655.00	0.09

483	002364	中恒电气	18,700	182,512.00	0.09
484	300298	三诺生物	15,480	182,354.40	0.09
485	300523	辰安科技	3,380	182,046.80	0.09
486	002293	罗莱生活	18,350	181,848.50	0.09
487	300066	三川智慧	33,800	181,844.00	0.09
488	600055	万东医疗	17,500	181,650.00	0.09
489	601113	华鼎股份	25,900	181,559.00	0.09
490	000030	富奥股份	38,800	181,196.00	0.09
491	600571	信雅达	19,400	180,808.00	0.09
492	000687	华讯方舟	25,600	180,736.00	0.09
493	002061	浙江交科	30,200	180,596.00	0.09
494	300096	易联众	19,000	180,500.00	0.09
495	000639	西王食品	21,100	180,194.00	0.09
496	002277	友阿股份	53,300	180,154.00	0.09
497	300487	蓝晓科技	5,700	179,664.00	0.09
498	002542	中化岩土	39,800	179,498.00	0.09
499	600662	强生控股	34,200	179,208.00	0.09
500	300075	数字政通	16,000	179,200.00	0.09
501	600810	神马股份	14,500	179,075.00	0.09
502	002256	兆新股份	61,800	178,602.00	0.09
503	600239	云南城投	61,507	178,370.30	0.09
504	000597	东北制药	16,100	178,227.00	0.09
505	300398	飞凯材料	14,360	178,207.60	0.09
506	603363	傲农生物	9,300	178,188.00	0.09
507	600773	西藏城投	26,400	177,672.00	0.09
508	600076	康欣新材	39,400	177,300.00	0.09
509	000155	川能动力	41,600	176,800.00	0.09
510	600322	天房发展	48,700	176,781.00	0.09
511	002043	兔宝宝	29,200	176,368.00	0.09
512	002327	富安娜	23,600	176,292.00	0.09
513	601606	长城军工	11,800	176,174.00	0.08
514	600261	阳光照明	47,900	175,793.00	0.08
515	002726	龙大肉食	16,070	174,841.60	0.08
516	300602	飞荣达	6,750	174,690.00	0.08
517	601952	苏垦农发	22,710	174,412.80	0.08
518	000049	德赛电池	6,700	174,401.00	0.08
519	300198	纳川股份	44,800	174,272.00	0.08
520	000973	佛塑科技	42,200	173,864.00	0.08
521	600681	百川能源	23,360	173,798.40	0.08
522	300219	鸿利智汇	23,500	173,430.00	0.08
523	002166	莱茵生物	21,520	173,236.00	0.08
524	601858	中国科传	13,200	173,052.00	0.08
525	300661	圣邦股份	1,700	173,009.00	0.08

526	002619	艾格拉斯	50,580	172,983.60	0.08
527	300366	创意信息	17,100	172,881.00	0.08
528	002308	威创股份	34,600	172,308.00	0.08
529	601388	怡球资源	76,900	172,256.00	0.08
530	300735	光弘科技	10,080	172,166.40	0.08
531	002355	兴民智通	20,700	172,017.00	0.08
532	002240	威华股份	20,500	171,995.00	0.08
533	002647	仁东控股	12,100	171,820.00	0.08
534	000620	新华联	41,500	171,810.00	0.08
535	300679	电连技术	6,166	171,784.76	0.08
536	002079	苏州固锟	23,600	171,572.00	0.08
537	002545	东方铁塔	26,900	171,353.00	0.08
538	300568	星源材质	7,400	170,570.00	0.08
539	600691	阳煤化工	64,800	170,424.00	0.08
540	002055	得润电子	15,800	170,324.00	0.08
541	002792	通宇通讯	7,400	169,978.00	0.08
542	600075	新疆天业	32,000	169,920.00	0.08
543	600676	交运股份	33,690	169,797.60	0.08
544	600106	重庆路桥	52,792	169,462.32	0.08
545	300506	名家汇	18,010	169,294.00	0.08
546	002283	天润曲轴	43,000	168,990.00	0.08
547	600480	凌云股份	19,290	168,787.50	0.08
548	603127	昭衍新药	3,500	168,630.00	0.08
549	000601	韶能股份	35,191	168,564.89	0.08
550	601163	三角轮胎	13,400	168,036.00	0.08
551	000584	哈工智能	23,200	167,504.00	0.08
552	300623	捷捷微电	7,400	167,388.00	0.08
553	002322	理工环科	13,300	167,314.00	0.08
554	300311	任子行	22,205	166,759.55	0.08
555	600389	江山股份	7,900	166,690.00	0.08
556	000525	红太阳	12,900	166,539.00	0.08
557	300252	金信诺	15,950	166,518.00	0.08
558	002462	嘉事堂	11,100	166,500.00	0.08
559	002540	亚太科技	35,100	166,374.00	0.08
560	002245	澳洋顺昌	38,000	166,060.00	0.08
561	600856	中天能源	52,300	165,791.00	0.08
562	600710	苏美达	28,800	165,600.00	0.08
563	300128	锦富技术	41,805	165,547.80	0.08
564	601101	昊华能源	26,600	165,186.00	0.08
565	002239	奥特佳	85,780	164,697.60	0.08
566	002443	金洲管道	22,900	164,651.00	0.08
567	600481	双良节能	44,500	164,650.00	0.08
568	300016	北陆药业	18,950	164,486.00	0.08

569	300083	劲胜智能	55,000	164,450.00	0.08
570	600929	湖南盐业	20,200	164,428.00	0.08
571	600184	光电股份	14,300	164,021.00	0.08
572	002530	金财互联	16,800	163,968.00	0.08
573	600552	凯盛科技	33,600	163,968.00	0.08
574	600568	中珠医疗	76,600	163,924.00	0.08
575	002279	久其软件	23,630	163,755.90	0.08
576	600227	圣济堂	56,600	163,574.00	0.08
577	300527	中国应急	14,735	162,821.75	0.08
578	002510	天汽模	40,200	162,810.00	0.08
579	000544	中原环保	21,500	162,755.00	0.08
580	002747	埃斯顿	18,500	162,615.00	0.08
581	002776	柏堡龙	9,900	161,865.00	0.08
582	002626	金达威	13,800	161,736.00	0.08
583	000797	中国武夷	35,441	161,256.55	0.08
584	603096	新经典	3,000	160,860.00	0.08
585	300255	常山药业	26,100	160,776.00	0.08
586	002695	煌上煌	11,200	160,720.00	0.08
587	603063	禾望电气	14,500	160,660.00	0.08
588	300107	建新股份	17,700	160,539.00	0.08
589	002148	北纬科技	25,200	160,272.00	0.08
590	300065	海兰信	13,300	159,866.00	0.08
591	002224	三力士	27,000	159,840.00	0.08
592	300157	恒泰艾普	31,100	159,543.00	0.08
593	002484	江海股份	26,290	159,317.40	0.08
594	600523	贵航股份	11,180	159,315.00	0.08
595	600800	天津磁卡	26,300	159,115.00	0.08
596	002630	华西能源	51,660	159,112.80	0.08
597	600855	航天长峰	11,400	158,346.00	0.08
598	002029	七匹狼	24,500	158,270.00	0.08
599	000802	北京文化	15,700	158,099.00	0.08
600	300409	道氏技术	12,500	157,875.00	0.08
601	002034	旺能环境	9,200	157,872.00	0.08
602	603989	艾华集团	8,350	157,648.00	0.08
603	000913	钱江摩托	15,300	157,590.00	0.08
604	002343	慈文传媒	20,820	157,399.20	0.08
605	600715	文投控股	40,600	157,122.00	0.08
606	600734	实达集团	16,600	157,036.00	0.08
607	002464	众应互联	19,616	156,928.00	0.08
608	601126	四方股份	26,200	156,676.00	0.08
609	603458	勘设股份	7,015	156,574.80	0.08
610	000665	湖北广电	18,800	156,416.00	0.08
611	603111	康尼机电	31,700	156,281.00	0.08

612	000950	重药控股	28,600	156,156.00	0.08
613	300224	正海磁材	17,600	156,112.00	0.08
614	300726	宏达电子	6,600	155,760.00	0.08
615	000150	宜华健康	28,244	155,342.00	0.07
616	002611	东方精工	40,300	155,155.00	0.07
617	600211	西藏药业	4,900	155,134.00	0.07
618	300309	吉艾科技	23,480	154,968.00	0.07
619	603220	贝 通 信	5,600	154,840.00	0.07
620	300343	联创股份	21,500	154,800.00	0.07
621	603357	设计总院	12,340	154,620.20	0.07
622	600581	八一钢铁	41,900	154,611.00	0.07
623	300021	大禹节水	26,150	154,546.50	0.07
624	002204	大连重工	42,200	154,452.00	0.07
625	300373	扬杰科技	10,300	154,397.00	0.07
626	002636	金安国纪	15,400	153,846.00	0.07
627	600382	广东明珠	19,990	153,723.10	0.07
628	600172	黄河旋风	47,640	153,400.80	0.07
629	002321	华英农业	23,600	153,400.00	0.07
630	600114	东睦股份	24,372	153,299.88	0.07
631	300737	科顺股份	16,300	153,220.00	0.07
632	600550	保变电气	40,400	153,116.00	0.07
633	300223	北京君正	5,499	152,982.18	0.07
634	000055	方大集团	29,850	152,832.00	0.07
635	300050	世纪鼎利	24,100	152,794.00	0.07
636	600758	红阳能源	29,400	152,586.00	0.07
637	002930	宏川智慧	9,460	151,833.00	0.07
638	002121	科陆电子	30,800	150,920.00	0.07
639	002554	惠 博 普	41,500	150,645.00	0.07
640	000545	金浦钛业	38,100	150,495.00	0.07
641	300438	鹏辉能源	9,300	150,474.00	0.07
642	002928	华夏航空	13,450	150,371.00	0.07
643	603803	瑞斯康达	11,600	150,336.00	0.07
644	300748	金力永磁	2,500	150,200.00	0.07
645	000407	胜利股份	38,800	150,156.00	0.07
646	002197	证通电子	19,800	150,084.00	0.07
647	000822	山东海化	29,500	149,860.00	0.07
648	300323	华灿光电	24,200	149,556.00	0.07
649	002582	好 想 你	16,500	149,490.00	0.07
650	000925	众合科技	21,020	149,242.00	0.07
651	002768	国恩股份	5,900	148,975.00	0.07
652	600995	文山电力	18,500	148,740.00	0.07
653	603636	南威软件	14,799	148,729.95	0.07
654	600508	上海能源	15,300	148,257.00	0.07

655	002433	太安堂	29,500	147,795.00	0.07
656	300256	星星科技	41,150	147,728.50	0.07
657	000927	一汽夏利	34,900	147,627.00	0.07
658	600103	青山纸业	62,980	147,373.20	0.07
659	601366	利群股份	23,500	147,345.00	0.07
660	300110	华仁药业	32,160	147,292.80	0.07
661	002060	粤水电	45,700	147,154.00	0.07
662	002253	川大智胜	9,900	147,114.00	0.07
663	600090	同济堂	31,400	146,952.00	0.07
664	600798	宁波海运	39,800	146,464.00	0.07
665	300388	国祯环保	15,500	146,165.00	0.07
666	002453	华软科技	24,600	146,124.00	0.07
667	600303	曙光股份	29,700	145,827.00	0.07
668	002229	鸿博股份	19,300	145,715.00	0.07
669	300008	天海防务	37,650	145,705.50	0.07
670	600229	城市传媒	19,400	145,694.00	0.07
671	600290	华仪电气	28,000	145,600.00	0.07
672	000815	美利云	15,700	145,539.00	0.07
673	600136	当代明诚	13,600	145,520.00	0.07
674	002664	长鹰信质	11,100	145,299.00	0.07
675	002929	润建股份	4,800	145,248.00	0.07
676	300006	莱美药业	31,100	145,237.00	0.07
677	603699	纽威股份	12,100	145,200.00	0.07
678	603387	基蛋生物	5,660	145,179.00	0.07
679	002448	中原内配	26,100	145,116.00	0.07
680	600231	凌钢股份	45,040	145,028.80	0.07
681	600318	新力金融	19,400	144,918.00	0.07
682	300007	汉威科技	11,400	144,666.00	0.07
683	300064	豫金刚石	33,100	144,647.00	0.07
684	603456	九洲药业	17,300	144,455.00	0.07
685	603393	新天然气	6,160	144,144.00	0.07
686	002378	章源钨业	19,500	143,910.00	0.07
687	603359	东珠生态	8,480	143,736.00	0.07
688	300262	巴安水务	21,350	143,685.50	0.07
689	603337	杰克股份	6,995	143,327.55	0.07
690	300634	彩讯股份	6,600	143,022.00	0.07
691	603980	吉华集团	15,780	142,966.80	0.07
692	000065	北方国际	16,375	142,953.75	0.07
693	002650	加加食品	38,100	142,494.00	0.07
694	601107	四川成渝	35,100	142,155.00	0.07
695	603308	应流股份	14,600	141,766.00	0.07
696	000615	京汉股份	26,200	141,218.00	0.07
697	300724	捷佳伟创	5,300	141,086.00	0.07

698	002320	海峡股份	15,750	140,805.00	0.07
699	603959	百利科技	9,760	140,544.00	0.07
700	000821	京山轻机	17,300	140,303.00	0.07
701	300364	中文在线	30,356	139,941.16	0.07
702	002617	露笑科技	32,150	139,531.00	0.07
703	002609	捷顺科技	17,300	139,092.00	0.07
704	601015	陕西黑猫	35,260	138,924.40	0.07
705	603367	辰欣药业	9,600	138,720.00	0.07
706	300424	航新科技	9,155	138,606.70	0.07
707	300386	飞天诚信	11,300	138,312.00	0.07
708	300263	隆华科技	29,300	138,003.00	0.07
709	300231	银信科技	19,500	137,670.00	0.07
710	600449	宁夏建材	16,200	137,376.00	0.07
711	000576	广东甘化	15,000	137,250.00	0.07
712	300571	平治信息	3,300	137,115.00	0.07
713	002329	皇氏集团	27,800	137,054.00	0.07
714	300759	康龙化成	4,000	136,720.00	0.07
715	603618	杭电股份	18,900	136,269.00	0.07
716	600278	东方创业	11,300	136,052.00	0.07
717	300229	拓尔思	12,900	135,966.00	0.07
718	000657	中钨高新	19,360	135,520.00	0.07
719	002314	南山控股	45,000	135,000.00	0.07
720	002094	青岛金王	25,960	134,992.00	0.07
721	300332	天壕环境	28,600	134,420.00	0.06
722	300477	合纵科技	15,800	133,984.00	0.06
723	300755	华致酒行	3,800	133,798.00	0.06
724	600054	黄山旅游	14,400	133,776.00	0.06
725	600684	珠江实业	33,260	133,372.60	0.06
726	300213	佳讯飞鸿	20,000	133,200.00	0.06
727	002218	拓日新能	40,600	133,168.00	0.06
728	002646	青青稞酒	9,900	132,264.00	0.06
729	601789	宁波建工	31,900	132,066.00	0.06
730	600295	鄂尔多斯	15,900	131,811.00	0.06
731	603298	杭叉集团	10,400	131,664.00	0.06
732	300465	高伟达	17,000	131,580.00	0.06
733	000881	中广核技	16,400	131,364.00	0.06
734	600501	航天晨光	14,200	130,924.00	0.06
735	000791	甘肃电投	30,440	130,892.00	0.06
736	000019	深粮控股	18,300	130,845.00	0.06
737	603979	金诚信	15,472	130,274.24	0.06
738	300215	电科院	20,700	129,789.00	0.06
739	002539	云图控股	27,900	129,735.00	0.06
740	600638	新黄浦	15,200	129,200.00	0.06

741	300302	同有科技	12,300	129,150.00	0.06
742	300336	新文化	30,900	128,853.00	0.06
743	002284	亚太股份	23,900	128,821.00	0.06
744	002519	银河电子	29,880	128,782.80	0.06
745	601330	绿色动力	8,300	128,733.00	0.06
746	002556	辉隆股份	23,300	128,383.00	0.06
747	300191	潜能恒信	7,000	128,310.00	0.06
748	603003	龙宇燃油	15,400	128,282.00	0.06
749	600467	好当家	48,300	127,995.00	0.06
750	000498	山东路桥	24,100	127,971.00	0.06
751	002653	海思科	9,000	127,800.00	0.06
752	600650	锦江投资	10,600	127,730.00	0.06
753	600180	瑞茂通	16,200	127,494.00	0.06
754	300607	拓斯达	3,600	127,368.00	0.06
755	002543	万和电气	9,480	127,221.60	0.06
756	300148	天舟文化	31,530	126,750.60	0.06
757	600630	龙头股份	15,600	126,516.00	0.06
758	300178	腾邦国际	20,500	126,075.00	0.06
759	000558	莱茵体育	35,100	126,009.00	0.06
760	600603	广汇物流	27,800	125,656.00	0.06
761	300143	盈康生命	15,400	125,510.00	0.06
762	300248	新开普	16,091	125,509.80	0.06
763	002335	科华恒盛	7,100	125,315.00	0.06
764	000557	西部创业	31,900	124,410.00	0.06
765	300410	正业科技	10,621	124,371.91	0.06
766	000711	京蓝科技	22,240	124,321.60	0.06
767	002840	华统股份	7,300	124,100.00	0.06
768	300307	慈星股份	17,800	123,888.00	0.06
769	300664	鹏鹞环保	10,500	123,795.00	0.06
770	300359	全通教育	20,300	123,627.00	0.06
771	002631	德尔未来	14,900	123,521.00	0.06
772	600533	栖霞建设	34,100	123,442.00	0.06
773	002581	未名医药	18,300	123,342.00	0.06
774	002741	光华科技	10,300	122,879.00	0.06
775	002451	摩恩电气	12,200	122,366.00	0.06
776	002362	汉王科技	8,100	122,310.00	0.06
777	600012	皖通高速	19,300	122,169.00	0.06
778	603313	梦百合	7,020	121,375.80	0.06
779	000837	秦川机床	27,200	121,312.00	0.06
780	600738	兰州民百	16,700	121,242.00	0.06
781	603920	世运电路	8,800	121,176.00	0.06
782	300288	朗玛信息	9,100	121,121.00	0.06
783	600686	金龙汽车	16,100	121,072.00	0.06

784	300328	宜安科技	12,400	120,900.00	0.06
785	601599	鹿港文化	38,500	120,890.00	0.06
786	000885	城发环境	10,800	120,636.00	0.06
787	002516	旷达科技	41,100	120,423.00	0.06
788	300441	鲍斯股份	14,940	120,416.40	0.06
789	000631	顺发恒业	40,100	120,300.00	0.06
790	300114	中航电测	12,900	120,099.00	0.06
791	600619	海立股份	13,000	119,860.00	0.06
792	002538	司尔特	23,300	119,762.00	0.06
793	002393	力生制药	4,960	119,436.80	0.06
794	000796	凯撒旅游	17,200	119,368.00	0.06
795	603008	喜临门	10,800	119,124.00	0.06
796	603896	寿仙谷	3,200	119,040.00	0.06
797	002638	勤上股份	41,500	118,690.00	0.06
798	300504	天邑股份	4,400	118,580.00	0.06
799	002305	南国置业	46,500	118,575.00	0.06
800	002755	奥赛康	10,200	118,422.00	0.06
801	300171	东富龙	13,600	117,912.00	0.06
802	002418	康盛股份	31,100	117,869.00	0.06
803	300741	华宝股份	3,700	117,290.00	0.06
804	300209	天泽信息	9,400	117,124.00	0.06
805	601566	九牧王	9,500	117,040.00	0.06
806	300317	珈伟新能	22,693	116,868.95	0.06
807	000923	河北宣工	6,800	116,348.00	0.06
808	300378	鼎捷软件	8,600	116,014.00	0.06
809	000151	中成股份	9,800	115,640.00	0.06
810	002662	京威股份	33,500	114,905.00	0.06
811	000532	华金资本	11,200	114,688.00	0.06
812	300304	云意电气	28,800	114,624.00	0.06
813	002101	广东鸿图	14,950	114,367.50	0.06
814	300751	迈为股份	900	114,084.00	0.06
815	300278	华昌达	19,500	114,075.00	0.06
816	000965	天保基建	30,400	114,000.00	0.05
817	000905	厦门港务	14,900	113,836.00	0.05
818	002658	雪迪龙	13,100	113,708.00	0.05
819	600781	辅仁药业	10,300	113,609.00	0.05
820	600310	桂东电力	22,400	113,568.00	0.05
821	002141	贤丰控股	31,000	113,150.00	0.05
822	603218	日月股份	5,820	112,908.00	0.05
823	603728	鸣志电器	9,200	112,884.00	0.05
824	300467	迅游科技	6,100	112,362.00	0.05
825	603299	苏盐井神	16,600	112,050.00	0.05
826	300429	强力新材	11,220	111,751.20	0.05

827	002518	科士达	12,470	111,731.20	0.05
828	002016	世荣兆业	13,600	111,520.00	0.05
829	002751	易尚展示	5,100	111,486.00	0.05
830	600069	银鸽投资	45,800	111,294.00	0.05
831	300684	中石科技	5,500	111,100.00	0.05
832	000561	烽火电子	16,100	111,090.00	0.05
833	002345	潮宏基	24,400	111,020.00	0.05
834	002756	永兴特钢	7,600	110,960.00	0.05
835	002502	骅威文化	32,100	110,424.00	0.05
836	002605	姚记扑克	10,500	110,250.00	0.05
837	002033	丽江旅游	18,310	109,493.80	0.05
838	002349	精华制药	18,500	109,335.00	0.05
839	300140	中环装备	9,400	109,322.00	0.05
840	002409	雅克科技	7,300	109,281.00	0.05
841	002833	弘亚数控	3,000	109,230.00	0.05
842	002913	奥士康	2,400	108,864.00	0.05
843	603826	坤彩科技	7,400	108,706.00	0.05
844	300368	汇金股份	15,000	108,450.00	0.05
845	300485	赛升药业	10,900	108,128.00	0.05
846	300276	三丰智能	12,800	108,032.00	0.05
847	300431	暴风集团	14,820	107,741.40	0.05
848	002178	延华智能	27,600	107,640.00	0.05
849	300439	美康生物	7,300	107,383.00	0.05
850	300510	金冠股份	19,399	107,276.47	0.05
851	300531	优博讯	6,100	107,116.00	0.05
852	603583	捷昌驱动	2,900	106,923.00	0.05
853	000517	荣安地产	34,800	106,836.00	0.05
854	300423	鲁亿通	8,000	106,480.00	0.05
855	002656	摩登大道	19,920	105,974.40	0.05
856	603898	好莱客	6,400	105,856.00	0.05
857	002590	万安科技	13,100	105,455.00	0.05
858	603808	歌力思	6,900	105,363.00	0.05
859	002137	麦达数字	15,700	105,347.00	0.05
860	603305	旭升股份	4,400	105,204.00	0.05
861	300497	富祥股份	7,000	105,070.00	0.05
862	002461	珠江啤酒	16,500	104,775.00	0.05
863	002562	兄弟科技	24,120	104,198.40	0.05
864	601500	通用股份	14,700	103,929.00	0.05
865	300723	一品红	2,600	103,428.00	0.05
866	601020	华钰矿业	8,800	103,136.00	0.05
867	603777	来伊份	7,180	102,386.80	0.05
868	600173	卧龙地产	23,900	102,292.00	0.05
869	300520	科大国创	6,140	102,231.00	0.05

870	300363	博腾股份	12,100	101,519.00	0.05
871	603421	鼎信通讯	5,200	101,400.00	0.05
872	002158	汉钟精机	11,600	101,152.00	0.05
873	603590	康辰药业	2,600	101,114.00	0.05
874	603612	索通发展	9,420	100,888.20	0.05
875	000626	远大控股	12,000	100,800.00	0.05
876	603587	地素时尚	4,400	100,056.00	0.05
877	002822	中装建设	15,900	99,852.00	0.05
878	002068	黑猫股份	20,000	99,800.00	0.05
879	603466	风语筑	6,000	99,300.00	0.05
880	002769	普路通	10,200	99,042.00	0.05
881	300097	智云股份	9,800	98,784.00	0.05
882	300221	银禧科技	15,300	98,685.00	0.05
883	002685	华东重机	16,900	98,527.00	0.05
884	300011	鼎汉技术	15,800	98,434.00	0.05
885	002232	启明信息	11,100	97,902.00	0.05
886	002918	蒙娜丽莎	8,350	97,778.50	0.05
887	000892	欢瑞世纪	26,300	97,310.00	0.05
888	603801	志邦家居	4,900	96,824.00	0.05
889	603595	东尼电子	4,428	96,574.68	0.05
890	001896	豫能控股	24,700	96,083.00	0.05
891	002759	天际股份	7,100	95,495.00	0.05
892	600618	氯碱化工	12,100	95,106.00	0.05
893	002584	西陇科学	18,900	94,500.00	0.05
894	603648	畅联股份	8,000	93,760.00	0.05
895	002246	北化股份	11,800	93,456.00	0.05
896	300511	雪榕生物	11,605	93,420.25	0.05
897	600207	安彩高科	19,000	93,290.00	0.04
898	002435	长江润发	20,300	92,974.00	0.04
899	603919	金徽酒	6,000	92,340.00	0.04
900	603126	中材节能	16,200	91,854.00	0.04
901	600242	中昌数据	10,000	91,200.00	0.04
902	002850	科达利	4,600	90,942.00	0.04
903	603579	荣泰健康	3,100	90,830.00	0.04
904	000514	渝开发	18,700	90,134.00	0.04
905	603619	中曼石油	4,200	90,006.00	0.04
906	002346	柘中股份	6,900	89,562.00	0.04
907	603603	博天环境	6,200	89,528.00	0.04
908	603385	惠达卫浴	9,860	89,233.00	0.04
909	300109	新开源	5,318	89,076.50	0.04
910	002852	道道全	6,340	88,950.20	0.04
911	000056	皇庭国际	20,400	88,740.00	0.04
912	000058	深赛格	15,700	87,920.00	0.04

913	000838	财信发展	23,500	87,890.00	0.04
914	603666	亿嘉和	1,600	87,632.00	0.04
915	603713	密尔克卫	2,500	87,075.00	0.04
916	300624	万兴科技	1,800	86,814.00	0.04
917	002712	思美传媒	12,500	86,750.00	0.04
918	603843	正平股份	10,900	86,655.00	0.04
919	000567	海德股份	10,500	86,205.00	0.04
920	300242	佳云科技	20,800	86,112.00	0.04
921	300673	佩蒂股份	3,200	85,184.00	0.04
922	002752	昇兴股份	13,300	84,854.00	0.04
923	000662	天夏智慧	18,200	84,630.00	0.04
924	603727	博迈科	5,100	83,283.00	0.04
925	603010	万盛股份	7,480	82,953.20	0.04
926	600283	钱江水利	7,459	82,794.90	0.04
927	603185	上机数控	2,100	82,635.00	0.04
928	000673	当代东方	21,500	82,560.00	0.04
929	002933	新兴装备	1,900	82,080.00	0.04
930	000011	深物业A	8,500	81,175.00	0.04
931	002782	可立克	6,600	81,114.00	0.04
932	603997	继峰股份	10,500	81,060.00	0.04
933	300682	朗新科技	4,500	81,000.00	0.04
934	002485	希努尔	11,800	80,358.00	0.04
935	300393	中来股份	7,560	80,211.60	0.04
936	300533	冰川网络	2,200	79,816.00	0.04
937	603693	江苏新能	6,400	79,552.00	0.04
938	002534	杭锅股份	11,700	79,209.00	0.04
939	002651	利君股份	16,200	79,056.00	0.04
940	002247	聚力文化	23,800	79,016.00	0.04
941	300625	三雄极光	5,700	78,945.00	0.04
942	603711	香飘飘	2,300	78,131.00	0.04
943	300061	康旗股份	11,300	77,631.00	0.04
944	300100	双林股份	10,200	77,520.00	0.04
945	603839	安正时尚	6,220	76,506.00	0.04
946	002351	漫步者	13,300	76,209.00	0.04
947	300432	富临精工	11,100	76,035.00	0.04
948	600381	青海春天	12,300	74,907.00	0.04
949	300173	智慧松德	15,500	74,865.00	0.04
950	603626	科森科技	9,440	74,859.20	0.04
951	600876	洛阳玻璃	6,400	74,624.00	0.04
952	603876	鼎胜新材	4,700	74,354.00	0.04
953	300740	御家汇	9,100	73,801.00	0.04
954	600933	爱柯迪	9,400	73,790.00	0.04
955	002895	川恒股份	6,300	73,143.00	0.04

956	603730	岱美股份	3,100	72,664.00	0.04
957	002287	奇正藏药	2,500	72,650.00	0.04
958	601619	嘉泽新能	15,700	72,534.00	0.03
959	002901	大博医疗	2,200	72,336.00	0.03
960	603303	得邦照明	8,000	71,520.00	0.03
961	603557	起步股份	8,000	71,520.00	0.03
962	300426	唐德影视	11,150	70,691.00	0.03
963	300674	宇信科技	2,400	67,656.00	0.03
964	603999	读者传媒	12,100	67,639.00	0.03
965	603098	森特股份	5,260	67,222.80	0.03
966	603348	文灿股份	3,600	66,168.00	0.03
967	002377	国创高新	14,600	65,846.00	0.03
968	300447	全信股份	5,930	65,467.20	0.03
969	603533	掌阅科技	4,000	64,360.00	0.03
970	300528	幸福蓝海	8,380	63,855.60	0.03
971	601882	海天精工	8,300	63,661.00	0.03
972	000038	深大通	8,960	63,168.00	0.03
973	603900	莱绅通灵	5,080	62,839.60	0.03
974	300613	富瀚微	700	62,524.00	0.03
975	603055	台华新材	8,140	62,108.20	0.03
976	002577	雷柏科技	5,700	61,275.00	0.03
977	603180	金牌厨柜	1,100	60,764.00	0.03
978	603103	横店影视	3,820	60,508.80	0.03
979	300660	江苏雷利	4,004	59,739.68	0.03
980	603013	亚普股份	3,700	58,756.00	0.03
981	603339	四方科技	3,800	58,444.00	0.03
982	603733	仙鹤股份	3,700	56,129.00	0.03
983	002911	佛燃股份	3,700	55,611.00	0.03
984	603165	荣晟环保	2,960	55,559.20	0.03
985	603555	贵人鸟	10,700	55,533.00	0.03
986	002907	华森制药	3,100	55,180.00	0.03
987	603105	芯能科技	4,900	54,292.00	0.03
988	603058	永吉股份	6,500	53,755.00	0.03
989	603773	沃格光电	1,700	53,176.00	0.03
990	002906	华阳集团	4,600	51,934.00	0.03
991	603680	今创集团	3,300	51,876.00	0.03
992	603358	华达科技	4,616	50,776.00	0.02
993	603081	大丰实业	4,000	50,200.00	0.02
994	300512	中亚股份	4,000	50,120.00	0.02
995	300518	盛讯达	2,000	48,960.00	0.02
996	603848	好太太	3,200	46,752.00	0.02
997	603596	伯特利	2,700	44,577.00	0.02
998	603861	白云电器	4,300	43,000.00	0.02

999	603676	卫 信 康	3,800	42,294.00	0.02
1,000	603277	银都股份	3,900	37,830.00	0.02

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

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	600968	海油发展	33,075	117,416.25	0.06
2	300782	卓 胜 微	743	80,927.56	0.04
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
5	603863	松炆资源	1,403	32,381.24	0.02
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
9	002356	*ST 赫美	1,770	4,867.50	0.00
10	600828	茂业商业	333	1,671.66	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300628	亿联网络	1,748,725.00	1.45
2	000977	浪潮信息	1,706,852.00	1.41
3	300347	泰格医药	1,630,477.00	1.35
4	002157	正邦科技	1,317,715.37	1.09
5	300226	上海钢联	1,300,612.00	1.08
6	300601	康泰生物	1,283,879.27	1.06
7	300616	尚品宅配	1,274,531.70	1.05
8	002821	凯 莱 英	1,248,053.00	1.03
9	300567	精测电子	1,082,780.00	0.90
10	300176	鸿特科技	1,048,548.60	0.87
11	300170	汉得信息	1,035,602.00	0.86
12	300014	亿纬锂能	1,016,816.00	0.84
13	300012	华测检测	1,013,414.00	0.84
14	300271	华宇软件	1,007,312.00	0.83
15	000735	罗 牛 山	963,321.00	0.80
16	002124	天邦股份	954,008.02	0.79
17	300529	健帆生物	951,302.00	0.79
18	002138	顺络电子	934,397.50	0.77
19	300098	高 新 兴	892,200.00	0.74

20	300203	聚光科技	873,108.00	0.72
----	--------	------	------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	2,560,393.00	2.12
2	002157	正邦科技	2,233,837.00	1.85
3	300601	康泰生物	1,945,526.00	1.61
4	002821	凯莱英	1,741,962.00	1.44
5	300628	亿联网络	1,638,723.00	1.36
6	300226	上海钢联	1,234,395.27	1.02
7	300616	尚品宅配	1,180,867.60	0.98
8	002812	恩捷股份	1,090,495.00	0.90
9	300009	安科生物	1,065,378.60	0.88
10	300207	欣旺达	1,008,695.00	0.83
11	300567	精测电子	989,878.50	0.82
12	000883	湖北能源	925,411.00	0.77
13	300529	健帆生物	867,916.00	0.72
14	300012	华测检测	864,116.00	0.71
15	300170	汉得信息	850,677.00	0.70
16	300271	华宇软件	815,560.00	0.67
17	600763	通策医疗	810,449.00	0.67
18	002419	天虹股份	801,614.00	0.66
19	300014	亿纬锂能	801,242.68	0.66
20	000735	罗牛山	795,219.00	0.66

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	268,948,872.99
卖出股票收入（成交）总额	221,053,296.71

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,369.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,369.00	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113529	绝味转债	220	28,369.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IC1912	IC1912	2	1,882,000.00	59,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					59,720.00
股指期货投资本期收益（元）					285,941.75
股指期货投资本期公允价值变动（元）					80,840.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内基金投资的前十名证券除大众公用（证券代码 600635）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 7 月 27 日，大众公用公告，大众公用存在涉嫌违反证券法律法规违规行为，中国证券监督管理委员会根据相关法律法规对公司进行立案调查。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 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。

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（元）
1	存出保证金	297,238.89
2	应收证券清算款	119,071.54
3	应收股利	-
4	应收利息	1,598.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	417,908.49

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

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	新股未上市

§ 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
5,386	59,578.91	70,954,700.00	22.11%	249,937,300.00	77.89%

本基金管理人暂未发行 1000ETF 联接基金。

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	中国国际金融股份有限公司	25,170,100.00	7.92%
2	第一创业证券股份有限公司	9,500,000.00	2.99%
3	颜飞	6,310,300.00	1.99%
4	方正证券股份有限公司	6,190,600.00	1.95%
5	中信证券股份有限公司	5,430,900.00	1.71%
6	招商证券股份有限公司	5,059,600.00	1.59%
7	中国银河证券股份有限公司	4,444,200.00	1.40%
8	徐洁静	4,188,000.00	1.32%
9	深圳霖润投资控股有限公司—霖润价值一号私募投资基金	2,603,000.00	0.82%
10	张瑞华	2,501,900.00	0.79%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	227,892,000.00
本报告期基金总申购份额	492,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	399,000,000.00
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	320,892,000.00

§ 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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	1	407,274,888.40	83.44%	40,736.73	83.44%	-
华泰证券	4	71,947,245.96	14.74%	7,194.83	14.74%	-
国信证券	1	8,893,754.16	1.82%	889.70	1.82%	-
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
万联证券	36,120.03	17.07%	-	-	-	-
华泰证券	26,134.40	12.35%	-	-	-	-
国信证券	149,327.10	70.58%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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都证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报	2019-03-11
2	南方基金关于旗下部分基金增加国盛证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报	2019-04-08
3	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中金公司为申购赎回代理券商的公告	证券日报	2019-04-15

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告》原文。

12.2 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。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>