

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资 基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55

8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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的情况.....	57
9	开放式基金份额变动	57
10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8	其他重大事件.....	60
11	影响投资者决策的其他重要信息	60
12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录.....	61
12.2	存放地点.....	61
12.3	查阅方式.....	62

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指工业 ETF
场内简称	工业 ETF
基金主代码	159953
交易代码	159953
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 13 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,166,421.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 7 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指工业指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	-2,229,329.04
本期利润	844,293.14
加权平均基金份额本期利润	0.0315
本期加权平均净值利润率	4.15%
本期基金份额净值增长率	5.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-3,584,277.81
期末可供分配基金份额利润	-0.2363
期末基金资产净值	12,053,203.64
期末基金份额净值	0.7947
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-20.53%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.16%	0.77%	5.71%	0.78%	0.45%	-0.01%
过去三个月	11.79%	1.00%	11.28%	1.01%	0.51%	-0.01%
过去六个月	5.08%	1.66%	4.56%	1.69%	0.52%	-0.03%
过去一年	6.34%	1.34%	5.41%	1.37%	0.93%	-0.03%
过去三年	-20.68%	1.33%	-21.82%	1.35%	1.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-20.53%	1.32%	-19.89%	1.34%	-0.64%	-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

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2017年6月13日至2020年6月30日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆志明	本基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型	2017-06-13	-	21 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)。

	<p>开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；量化投资部副总经理</p>				
--	---	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2020 年上半年，疫情在全球蔓延，全球经济受到严重打击，中国在疫情防控方面较为成功，经济也从疫情中快速复苏。上半年国内生产总值同比下降 1.6%，分季度看，一季度同比下降 6.8%，二季度增长 3.2%。上证指数下跌 2.15%，深证成指上涨 14.97%，中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.60%，中证全指工业指数上涨 4.56%。从工业企业基本面的角度看，1 月-5 月份全国规模以上工业企业利润总额同比下降 19.30%，较第 1 季度有了明显的改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 5.08%，同期业绩比较基准收益率为 4.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国疫情防控形势持续向好，复工、复产、复商、复市加快推进，主要的经济指标恢复增长，经济运行稳步复苏，市场预期总体向好，社会发展大局稳定。随着复工复产的有序进行，工业利润预计将会继续保持环比增长。从国家经济发展的角度看，工业是国民经济的支柱产业，是国家安全和人民幸福的物质保障，是衡量一个国家或地区综合经济实力和国际竞争力的重要标志。长期来看，智能制造、绿色制造、高端装备是未来工业的主要发展方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金于 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 6 月 30 日出现了基金资产净值低于五千万的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	465,460.90	284,969.47
结算备付金		-	-
存出保证金		1,107.78	324.14
交易性金融资产	6.4.7.2	11,763,880.20	20,301,985.50
其中：股票投资		11,760,124.80	20,301,985.50
基金投资		-	-
债券投资		3,755.40	-
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		25,641.27	-
应收利息	6.4.7.5	101.27	52.51
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		12,256,191.42	20,587,331.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		174,845.43	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,047.65	8,411.59
应付托管费		1,409.53	1,682.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,233.77	2,978.33
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	15,451.40	27,500.00
负债合计		202,987.78	40,572.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	15,166,421.00	27,166,421.00
未分配利润	6.4.7.10	-3,113,217.36	-6,619,661.59
所有者权益合计		12,053,203.64	20,546,759.41

负债和所有者权益总计		12,256,191.42	20,587,331.62
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7947 元，基金份额总额 15,166,421.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		927,311.14	3,576,128.02
1.利息收入		1,234.80	951.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,229.35	951.23
债券利息收入		5.45	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,161,023.92	-965,192.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,253,265.34	-1,117,809.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,644.15	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	90,597.27	152,616.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,073,622.18	4,540,369.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,478.08	-
减：二、费用		83,018.00	129,393.20
1. 管理人报酬		50,280.27	55,545.92
2. 托管费		10,056.00	11,109.19
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	10,533.99	4,051.36
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	12,147.74	58,686.73

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		844,293.14	3,446,734.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		844,293.14	3,446,734.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	27,166,421.00	-6,619,661.59	20,546,759.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	844,293.14	844,293.14
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）	-12,000,000.00	2,662,151.09	-9,337,848.91
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	-827,629.34	3,172,370.66
2.基金赎回款	-16,000,000.00	3,489,780.43	-12,510,219.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,166,421.00	-3,113,217.36	12,053,203.64
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	31,166,421.00	-11,169,204.85	19,997,216.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,446,734.82	3,446,734.82
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）	-2,000,000.00	351,428.29	-1,648,571.71
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-2,000,000.00	351,428.29	-1,648,571.71

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）	29,166,421.00	-7,371,041.74	21,795,379.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2015]1447 号文核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2017 年 6 月 13 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2017 年 5 月 3 日至 2017 年 6 月 5 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 291,166,421.00 元，有效认购户数为 3,345 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 20,306.00 元，折合基金份额 291,166,421.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	465,460.90
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	465,460.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,066,374.39	11,760,124.80	-1,306,249.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,000.00	3,755.40
	银行间市场	-	-
	合计	3,000.00	3,755.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,069,374.39	11,763,880.20	-1,305,494.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	99.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.45
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1.12
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
应收出借证券利息	
其他	
合计	101.27

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,233.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,233.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	8,701.42
应付替代款	3,733.18
应付指数使用费	3,016.80
合计	15,451.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,166,421.00	27,166,421.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-16,000,000.00
本期末	15,166,421.00	15,166,421.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,643,585.76	-2,976,075.83	-6,619,661.59
本期利润	-2,229,329.04	3,073,622.18	844,293.14

本期基金份额交易产生的变动数	2,288,636.99	373,514.10	2,662,151.09
其中：基金申购款	-542,831.22	-284,798.12	-827,629.34
基金赎回款	2,831,468.21	658,312.22	3,489,780.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,584,277.81	471,060.45	-3,113,217.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,180.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6.95
结算备付金利息收入	41.80
其他	-
合计	1,229.35

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,094,452.98
股票投资收益——赎回差价收入	-1,158,812.36
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,253,265.34

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,482,115.25
减：卖出股票成本总额	5,576,568.23
买卖股票差价收入	-1,094,452.98

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	12,510,219.57
减：现金支付赎回款总额	3,819,960.57
减：赎回股票成本总额	9,849,071.36

赎回差价收入	-1,158,812.36
--------	---------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,644.15
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,644.15

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,248.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,600.00
减：应收利息总额	4.33
买卖债券差价收入	1,644.15

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	90,597.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	90,597.27

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	3,073,622.18
——股票投资	3,072,866.78

——债券投资	755.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	3,073,622.18

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	13,478.08
合计	13,478.08

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代股票的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）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（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	10,533.99
银行间市场交易费用	-
合计	10,533.99

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	8,701.42
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	429.52
指数使用费	3,016.80
合计	12,147.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	1,593,558.57	22.71%	1,434,063.59	50.75%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	15,868.50	56.98%	-	-

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	1,464.56	26.97%	1,427.48	33.72%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	1,277.90	55.67%	1,220.19	56.33%

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	50,280.27	55,545.92
其中：支付销售机构的客户维护费	190.80	195.98

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,056.00	11,109.19

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
广发中证全指工 业交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金	-	-	12,587,457.00	46.33%

注：本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	465,460.90	1,180.60	226,447.11	930.72

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
60188 0	大连港	2020-06 -22	重大事 项停牌	1.72	2020-0 7-08	1.89	8,900.00	25,366.82	15,308.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	3,755.40	-
未评级	-	-
合计	3,755.40	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	465,460.90	-	-	-	465,460.90
存出保证金	1,107.78	-	-	-	1,107.78
交易性金融资产	3,755.40	-	-	11,760,124.80	11,763,880.20
应收证券清算款	-	-	-	25,641.27	25,641.27
应收利息	-	-	-	101.27	101.27
资产总计	470,324.08	-	-	11,785,867.34	12,256,191.42
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	174,845.43	174,845.43
应付管理人报酬	-	-	-	7,047.65	7,047.65
应付托管费	-	-	-	1,409.53	1,409.53
应付交易费用	-	-	-	4,233.77	4,233.77
其他负债	-	-	-	15,451.40	15,451.40
负债总计	-	-	-	202,987.78	202,987.78
利率敏感度缺口	470,324.08	-	-	11,582,879.56	12,053,203.64
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	284,969.47	-	-	-	284,969.47
存出保证金	324.14	-	-	-	324.14
交易性金融资产	-	-	-	20,301,985.50	20,301,985.50
应收利息	-	-	-	52.51	52.51
资产总计	285,293.61	-	-	20,302,038.01	20,587,331.62
负债：					
应付管理人报酬	-	-	-	8,411.59	8,411.59
应付托管费	-	-	-	1,682.29	1,682.29
应付交易费用	-	-	-	2,978.33	2,978.33

其他负债	-	-	-	27,500.00	27,500.00
负债总计	-	-	-	40,572.21	40,572.21
利率敏感度缺口	285,293.61	-	-	20,261,465.80	20,546,759.41

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末持有的债券占基金资产净值较小，上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	11,760,124.80	97.57	20,301,985.50	98.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,755.40	0.03	-	-
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	11,763,880.20	97.60	20,301,985.50	98.81
----	---------------	-------	---------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	702,670.92	1,093,967.04
	业绩比较基准下降 5%	-702,670.92	-1,093,967.04

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 11,748,572.20 元，属于第二层次的余额为人民币 15,308.00 元，无属于第三层次的金額（2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 20,295,442.50 元，属于第二层次的余额为人民币 6,543.00 元，无属于第三层次的金額）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,760,124.80	95.95
	其中：股票	11,760,124.80	95.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,755.40	0.03
	其中：债券	3,755.40	0.03
	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	465,460.90	3.80
8	其他各项资产	26,850.32	0.22
9	合计	12,256,191.42	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,052.00	0.05
B	采矿业	27,575.30	0.23
C	制造业	7,156,083.30	59.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,406.00	0.23
E	建筑业	1,319,743.96	10.95
F	批发和零售业	347,733.94	2.88
G	交通运输、仓储和邮政业	1,716,457.25	14.24

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,966.00	1.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	313,266.32	2.60
M	科学研究和技术服务业	242,220.63	2.01
N	水利、环境和公共设施管理业	350,830.70	2.91
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	15,101.00	0.13
S	综合	101,688.40	0.84
	合计	11,760,124.80	97.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,800	488,208.00	4.05
2	600031	三一重工	15,900	298,284.00	2.47
3	601012	隆基股份	7,114	289,753.22	2.40
4	601668	中国建筑	56,500	269,505.00	2.24
5	600009	上海机场	2,600	187,382.00	1.55
6	000338	潍柴动力	12,900	176,988.00	1.47
7	002352	顺丰控股	3,200	175,040.00	1.45
8	601766	中国中车	29,800	165,986.00	1.38
9	600406	国电南瑞	6,200	125,550.00	1.04
10	300014	亿纬锂能	2,462	117,806.70	0.98
11	601006	大秦铁路	16,000	112,640.00	0.93
12	002129	中环股份	4,800	107,808.00	0.89
13	601390	中国中铁	21,300	106,926.00	0.89

14	300124	汇川技术	2,800	106,372.00	0.88
15	002050	三花智控	4,796	105,032.40	0.87
16	601186	中国铁建	12,400	103,912.00	0.86
17	601989	中国重工	24,600	98,400.00	0.82
18	002127	南极电商	4,600	97,382.00	0.81
19	000157	中联重科	13,800	88,734.00	0.74
20	600739	辽宁成大	4,100	77,613.00	0.64
21	000425	徐工机械	12,700	75,057.00	0.62
22	002202	金风科技	7,448	74,256.56	0.62
23	601669	中国电建	20,600	71,276.00	0.59
24	601877	正泰电器	2,700	71,145.00	0.59
25	300012	华测检测	3,600	71,136.00	0.59
26	002120	韵达股份	2,821	68,973.45	0.57
27	600089	特变电工	10,000	67,700.00	0.56
28	000768	中航飞机	3,700	65,638.00	0.54
29	601800	中国交建	8,600	63,124.00	0.52
30	300450	先导智能	1,296	59,888.16	0.50
31	000009	中国宝安	6,940	59,059.40	0.49
32	600029	南方航空	11,400	58,938.00	0.49
33	601100	恒立液压	720	57,744.00	0.48
34	300207	欣旺达	3,000	56,700.00	0.47
35	600893	航发动力	2,400	56,352.00	0.47
36	002074	国轩高科	2,090	56,095.60	0.47
37	603899	晨光文具	1,000	54,600.00	0.45
38	002212	南洋股份	2,000	53,160.00	0.44
39	601111	中国国航	7,900	52,219.00	0.43
40	600115	东方航空	11,900	50,218.00	0.42
41	601727	上海电气	9,800	49,392.00	0.41
42	600118	中国卫星	1,600	49,328.00	0.41
43	601618	中国中冶	19,200	48,192.00	0.40
44	002414	高德红外	1,600	46,848.00	0.39
45	002340	格林美	9,400	46,718.00	0.39
46	600221	海航控股	31,000	46,500.00	0.39
47	600233	圆通速递	3,100	45,136.00	0.37
48	600885	宏发股份	1,120	44,934.40	0.37
49	601816	京沪高铁	7,200	44,856.00	0.37
50	300724	捷佳伟创	500	44,265.00	0.37
51	600068	葛洲坝	7,400	44,030.00	0.37
52	300316	晶盛机电	1,740	43,047.60	0.36
53	000547	航天发展	3,100	42,377.00	0.35
53	300024	机器人	3,100	42,377.00	0.35
54	600004	白云机场	2,765	42,138.60	0.35
55	300070	碧水源	5,100	41,412.00	0.34
56	601919	中远海控	11,900	41,293.00	0.34

57	603659	璞泰来	400	41,208.00	0.34
58	600018	上港集团	9,400	39,480.00	0.33
59	300274	阳光电源	2,700	38,853.00	0.32
60	002013	中航机电	4,900	38,710.00	0.32
61	600150	中国船舶	2,200	38,368.00	0.32
62	603338	浙江鼎力	502	38,036.54	0.32
63	600879	航天电子	5,900	37,996.00	0.32
64	601018	宁波港	10,600	37,842.00	0.31
65	600984	建设机械	1,510	37,448.00	0.31
66	600170	上海建工	12,000	36,840.00	0.31
67	600884	杉杉股份	3,050	35,959.50	0.30
68	600415	小商品城	7,300	35,551.00	0.29
69	601021	春秋航空	1,000	35,240.00	0.29
70	601117	中国化学	6,300	34,524.00	0.29
71	601872	招商轮船	5,900	34,397.00	0.29
72	600153	建发股份	4,200	34,020.00	0.28
73	300001	特锐德	1,600	33,504.00	0.28
74	600482	中国动力	2,100	32,970.00	0.27
75	600760	中航沈飞	1,003	32,918.46	0.27
76	600038	中直股份	800	32,856.00	0.27
77	002028	思源电气	1,600	32,736.00	0.27
78	300457	赢合科技	1,025	32,677.00	0.27
79	300073	当升科技	900	29,763.00	0.25
80	300751	迈为股份	100	29,696.00	0.25
81	600528	中铁工业	3,300	29,106.00	0.24
82	600820	隧道股份	5,100	28,815.00	0.24
83	600704	物产中大	6,800	28,628.00	0.24
84	002081	金螳螂	3,600	28,296.00	0.23
85	002791	坚朗五金	300	28,227.00	0.23
86	603806	福斯特	558	27,849.78	0.23
87	603686	龙马环卫	1,100	26,807.00	0.22
88	601179	中国西电	5,500	26,620.00	0.22
89	600875	东方电气	3,000	26,550.00	0.22
90	603638	艾迪精密	495	25,938.00	0.22
91	002025	航天电器	700	25,606.00	0.21
92	300118	东方日升	1,700	25,500.00	0.21
93	600862	中航高科	1,489	25,193.88	0.21
94	002706	良信电器	1,500	25,020.00	0.21
95	002056	横店东磁	2,200	24,750.00	0.21
96	002468	申通快递	1,500	24,615.00	0.20
97	002023	海特高新	1,600	24,592.00	0.20
98	600546	山煤国际	2,070	24,322.50	0.20
99	000090	天健集团	3,518	24,309.38	0.20
100	600323	瀚蓝环境	1,100	24,068.00	0.20

101	600026	中远海能	3,700	23,902.00	0.20
102	600967	内蒙一机	2,300	23,897.00	0.20
103	002413	雷科防务	3,000	23,040.00	0.19
104	600755	厦门国贸	3,400	22,440.00	0.19
105	603568	伟明环保	951	22,063.20	0.18
106	000035	中国天楹	4,300	21,930.00	0.18
106	002541	鸿路钢构	750	21,930.00	0.18
107	000951	中国重汽	700	21,882.00	0.18
108	600491	龙元建设	2,500	21,600.00	0.18
109	000967	盈峰环境	2,600	21,450.00	0.18
110	002183	怡亚通	4,000	21,440.00	0.18
111	002595	豪迈科技	1,100	21,406.00	0.18
112	002191	劲嘉股份	2,400	21,384.00	0.18
113	600580	卧龙电驱	1,900	21,356.00	0.18
114	600435	北方导航	2,800	21,168.00	0.18
115	000400	许继电气	1,600	21,120.00	0.18
116	600039	四川路桥	5,500	21,010.00	0.17
117	300397	天和防务	860	20,992.60	0.17
118	603713	密尔克卫	200	20,804.00	0.17
119	601106	中国一重	7,400	20,794.00	0.17
120	000089	深圳机场	2,700	20,682.00	0.17
121	002506	协鑫集成	7,900	20,619.00	0.17
122	000039	中集集团	2,840	20,533.20	0.17
123	000738	航发控制	1,500	20,475.00	0.17
123	601333	广深铁路	9,100	20,475.00	0.17
124	601975	招商南油	8,500	20,315.00	0.17
125	300474	景嘉微	300	20,190.00	0.17
126	002389	航天彩虹	1,500	20,175.00	0.17
127	002372	伟星新材	1,724	20,050.12	0.17
128	601866	中远海发	10,700	19,688.00	0.16
129	000903	云内动力	3,600	19,368.00	0.16
130	600711	盛屯矿业	3,700	19,018.00	0.16
131	002310	东方园林	3,900	18,837.00	0.16
132	002851	麦格米特	725	18,792.00	0.16
133	600517	国网英大	2,800	18,704.00	0.16
134	600372	中航电子	1,400	18,648.00	0.15
135	600388	龙净环保	2,100	18,480.00	0.15
136	002375	亚厦股份	1,800	18,396.00	0.15
137	000415	渤海租赁	6,100	18,178.00	0.15
138	300068	南都电源	1,700	18,122.00	0.15
139	000519	中兵红箭	1,900	17,898.00	0.15
140	601000	唐山港	7,930	17,683.90	0.15
141	000528	柳工	2,790	17,604.90	0.15
142	000652	泰达股份	2,800	17,500.00	0.15

143	601615	明阳智能	1,400	17,430.00	0.14
144	002010	传化智联	3,200	17,408.00	0.14
145	600316	洪都航空	1,100	17,380.00	0.14
146	002850	科达利	250	17,300.00	0.14
147	000582	北部湾港	1,600	17,184.00	0.14
148	002498	汉缆股份	3,600	16,776.00	0.14
149	002169	智光电气	1,700	16,677.00	0.14
150	002266	浙富控股	4,300	16,641.00	0.14
151	002444	巨星科技	1,400	16,632.00	0.14
152	002301	齐心集团	1,000	16,420.00	0.14
153	600093	易见股份	1,400	16,408.00	0.14
154	600312	平高电气	2,200	16,324.00	0.14
155	603606	东方电缆	1,100	15,994.00	0.13
156	601608	中信重工	4,671	15,974.82	0.13
157	002698	博实股份	1,250	15,937.50	0.13
158	600057	厦门象屿	2,899	15,886.52	0.13
159	002163	海南发展	1,700	15,368.00	0.13
160	600765	中航重机	1,500	15,330.00	0.13
161	601880	大连港	8,900	15,308.00	0.13
162	000008	神州高铁	5,200	15,288.00	0.13
163	600320	振华重工	5,320	15,268.40	0.13
164	600835	上海机电	900	15,237.00	0.13
165	600685	中船防务	900	15,219.00	0.13
166	601228	广州港	5,000	15,200.00	0.13
167	603588	高能环境	1,300	15,158.00	0.13
168	600110	诺德股份	3,100	15,128.00	0.13
169	300203	聚光科技	900	15,057.00	0.12
170	600970	中材国际	2,800	14,784.00	0.12
171	000049	德赛电池	300	14,703.00	0.12
172	000429	粤高速 A	2,100	14,679.00	0.12
173	600478	科力远	3,100	14,601.00	0.12
174	603885	吉祥航空	1,600	14,560.00	0.12
175	000976	华铁股份	2,600	14,508.00	0.12
176	002531	天顺风能	2,400	14,352.00	0.12
177	002276	万马股份	2,000	14,280.00	0.12
177	603308	应流股份	700	14,280.00	0.12
178	002430	杭氧股份	1,000	14,200.00	0.12
179	600717	天津港	3,212	14,197.04	0.12
180	600648	外高桥	1,000	14,140.00	0.12
181	300045	华力创通	1,102	14,138.66	0.12
182	300607	拓斯达	346	14,078.74	0.12
183	300568	星源材质	753	14,020.86	0.12
184	300123	亚光科技	1,220	13,993.40	0.12
185	600125	铁龙物流	2,500	13,950.00	0.12

186	601200	上海环境	1,160	13,920.00	0.12
187	002091	江苏国泰	2,300	13,915.00	0.12
188	002918	蒙娜丽莎	465	13,908.15	0.12
189	601598	中国外运	4,274	13,805.02	0.11
190	300185	通裕重工	7,000	13,720.00	0.11
191	603583	捷昌驱动	200	13,676.00	0.11
192	600525	长园集团	2,800	13,580.00	0.11
193	300284	苏交科	1,824	13,570.56	0.11
194	600662	强生控股	1,700	13,566.00	0.11
195	002665	首航高科	5,500	13,420.00	0.11
196	002249	大洋电机	3,700	13,357.00	0.11
197	000826	启迪环境	1,800	13,356.00	0.11
198	000061	农产品	1,800	13,338.00	0.11
199	600761	安徽合力	1,380	13,303.20	0.11
200	600545	卓郎智能	2,800	13,244.00	0.11
201	600582	天地科技	4,500	13,185.00	0.11
202	002747	埃斯顿	1,100	13,156.00	0.11
203	002459	晶澳科技	700	13,146.00	0.11
204	600496	精工钢构	3,900	13,065.00	0.11
205	603018	中设集团	1,342	13,057.66	0.11
206	601567	三星医疗	1,900	13,015.00	0.11
207	300376	易事特	2,500	13,000.00	0.11
208	601611	中国核建	2,100	12,978.00	0.11
209	002610	爱康科技	9,700	12,901.00	0.11
210	000062	深圳华强	885	12,867.90	0.11
211	600499	科达制造	3,100	12,772.00	0.11
212	600377	宁沪高速	1,300	12,753.00	0.11
213	300263	隆华科技	1,600	12,752.00	0.11
214	002733	雄韬股份	600	12,750.00	0.11
215	600477	杭萧钢构	3,476	12,617.88	0.10
216	300470	中密控股	400	12,600.00	0.10
217	600151	航天机电	2,600	12,558.00	0.10
218	300151	昌红科技	700	12,523.00	0.10
219	300159	新研股份	3,200	12,512.00	0.10
220	002135	东南网架	1,700	12,495.00	0.10
221	300664	鹏鹞环保	1,350	12,460.50	0.10
222	600017	日照港	5,000	12,450.00	0.10
223	603690	至纯科技	300	12,414.00	0.10
224	002320	海峡股份	1,127	12,397.00	0.10
225	000697	炼石航空	1,300	12,324.00	0.10
226	600284	浦东建设	2,000	12,300.00	0.10
227	603666	亿嘉和	140	12,286.40	0.10
228	300815	玉禾田	100	12,264.00	0.10
229	002364	中恒电气	900	12,195.00	0.10

230	300101	振芯科技	1,100	12,155.00	0.10
231	600072	中船科技	1,100	12,078.00	0.10
232	600869	智慧能源	3,000	12,000.00	0.10
233	002097	山河智能	2,000	11,940.00	0.10
234	600990	四创电子	300	11,910.00	0.10
235	300767	震安科技	180	11,871.00	0.10
236	000088	盐田港	2,000	11,840.00	0.10
237	600200	江苏吴中	1,800	11,826.00	0.10
238	300257	开山股份	900	11,763.00	0.10
239	002611	东方精工	2,540	11,709.40	0.10
240	300177	中海达	1,200	11,676.00	0.10
241	601828	美凯龙	1,100	11,649.00	0.10
242	300055	万邦达	1,900	11,628.00	0.10
243	002545	东方铁塔	1,500	11,520.00	0.10
244	601908	京运通	2,600	11,336.00	0.09
245	300171	东富龙	700	11,326.00	0.09
246	601369	陕鼓动力	1,800	11,322.00	0.09
247	002117	东港股份	1,000	11,280.00	0.09
248	300034	钢研高纳	600	11,256.00	0.09
249	600391	航发科技	600	11,226.00	0.09
250	002717	岭南股份	2,590	11,137.00	0.09
251	002047	宝鹰股份	2,200	11,132.00	0.09
252	000900	现代投资	2,900	11,107.00	0.09
253	600217	中再资环	2,300	11,086.00	0.09
254	600846	同济科技	1,300	11,050.00	0.09
255	600114	东睦股份	1,060	11,002.80	0.09
256	002130	沃尔核材	2,400	10,968.00	0.09
257	600611	大众交通	2,900	10,904.00	0.09
258	002967	广电计量	400	10,840.00	0.09
259	600375	华菱星马	1,400	10,836.00	0.09
260	603056	德邦股份	800	10,824.00	0.09
261	600269	赣粤高速	3,100	10,819.00	0.09
262	002672	东江环保	1,200	10,812.00	0.09
263	002617	露笑科技	2,200	10,692.00	0.09
264	600512	腾达建设	3,900	10,647.00	0.09
265	300145	中金环境	3,380	10,545.60	0.09
266	600787	中储股份	2,400	10,536.00	0.09
267	600502	安徽建工	2,720	10,499.20	0.09
268	002367	康力电梯	1,200	10,476.00	0.09
269	300438	鹏辉能源	600	10,470.00	0.09
270	002034	旺能环境	600	10,464.00	0.09
271	600350	山东高速	1,700	10,438.00	0.09
272	603218	日月股份	570	10,431.00	0.09
273	000682	东方电子	2,100	10,416.00	0.09

274	002822	中装建设	1,200	10,272.00	0.09
275	300197	铁汉生态	4,000	10,160.00	0.08
276	300035	中科电气	1,100	10,098.00	0.08
277	001965	招商公路	1,500	10,095.00	0.08
278	600577	精达股份	3,600	10,008.00	0.08
279	603060	国检集团	500	9,995.00	0.08
280	603012	创力集团	1,400	9,982.00	0.08
281	002111	威海广泰	700	9,975.00	0.08
282	002479	富春环保	1,700	9,962.00	0.08
283	300441	鲍斯股份	920	9,908.40	0.08
284	603111	康尼机电	1,600	9,904.00	0.08
285	002928	华夏航空	650	9,782.50	0.08
286	603887	城地股份	400	9,760.00	0.08
287	601890	亚星锚链	1,800	9,738.00	0.08
288	002073	软控股份	2,500	9,725.00	0.08
289	603960	克来机电	348	9,716.16	0.08
290	600592	龙溪股份	800	9,712.00	0.08
291	002639	雪人股份	1,400	9,660.00	0.08
292	601298	青岛港	1,700	9,656.00	0.08
293	601326	秦港股份	3,800	9,538.00	0.08
294	300495	美尚生态	1,000	9,520.00	0.08
295	603298	杭叉集团	860	9,477.20	0.08
296	002051	中工国际	1,300	9,464.00	0.08
297	000507	珠海港	1,800	9,432.00	0.08
298	300266	兴源环境	2,850	9,348.00	0.08
298	603699	纽威股份	600	9,348.00	0.08
299	300486	东杰智能	500	9,330.00	0.08
300	603128	华贸物流	1,600	9,296.00	0.08
301	002573	清新环境	1,700	9,282.00	0.08
302	000680	山推股份	2,700	9,261.00	0.08
303	600880	博瑞传播	2,000	9,260.00	0.08
304	600169	太原重工	4,800	9,168.00	0.08
305	000777	中核科技	800	9,104.00	0.08
306	300048	合康新能	2,400	9,096.00	0.08
307	002526	山东矿机	3,798	9,077.22	0.08
308	300477	合纵科技	1,288	9,067.52	0.08
309	300696	爱乐达	250	8,970.00	0.07
310	300222	科大智能	1,100	8,921.00	0.07
311	300662	科锐国际	200	8,900.00	0.07
312	002837	英维克	300	8,886.00	0.07
313	600495	晋西车轴	2,300	8,832.00	0.07
314	002307	北新路桥	1,480	8,820.80	0.07
315	600620	天宸股份	1,500	8,820.00	0.07
316	600575	淮河能源	4,200	8,778.00	0.07

317	300190	维尔利	1,160	8,758.00	0.07
318	300384	三联虹普	500	8,740.00	0.07
319	300125	聆达股份	600	8,700.00	0.07
320	600550	保变电气	1,800	8,694.00	0.07
321	002884	凌霄泵业	513	8,674.83	0.07
322	300137	先河环保	1,300	8,671.00	0.07
323	600973	宝胜股份	2,200	8,646.00	0.07
324	002204	大连重工	2,000	8,600.00	0.07
325	603611	诺力股份	400	8,584.00	0.07
326	603979	金诚信	830	8,557.30	0.07
327	600790	轻纺城	2,740	8,521.40	0.07
328	300198	纳川股份	2,200	8,514.00	0.07
329	300527	中船应急	938	8,507.66	0.07
330	600020	中原高速	2,400	8,496.00	0.07
331	002158	汉钟精机	600	8,490.00	0.07
332	600133	东湖高新	1,500	8,475.00	0.07
333	002335	科华恒盛	400	8,436.00	0.07
334	002431	棕榈股份	2,800	8,400.00	0.07
335	300726	宏达电子	300	8,343.00	0.07
336	300355	蒙草生态	3,100	8,339.00	0.07
337	300427	红相股份	500	8,330.00	0.07
338	600428	中远海特	2,700	8,316.00	0.07
339	002556	辉隆股份	1,000	8,260.00	0.07
340	300388	国祯环保	880	8,113.60	0.07
341	300097	智云股份	500	8,105.00	0.07
342	601606	长城军工	600	8,088.00	0.07
343	603185	上机数控	164	8,034.36	0.07
344	002930	宏川智慧	570	8,019.90	0.07
345	300091	金通灵	2,270	8,013.10	0.07
346	002358	森源电气	1,600	7,984.00	0.07
347	601700	风范股份	1,500	7,890.00	0.07
348	000925	众合科技	1,080	7,873.20	0.07
349	002480	新筑股份	1,400	7,868.00	0.07
350	000551	创元科技	800	7,856.00	0.07
351	603337	杰克股份	358	7,840.20	0.07
352	300393	中来股份	1,172	7,828.96	0.06
353	002523	天桥起重	3,076	7,782.28	0.06
354	300443	金雷股份	400	7,780.00	0.06
355	002061	浙江交科	1,500	7,770.00	0.06
356	600343	航天动力	1,000	7,760.00	0.06
357	002663	普邦股份	3,400	7,752.00	0.06
358	002309	中利集团	1,400	7,700.00	0.06
359	300423	鲁亿通	620	7,663.20	0.06
360	002339	积成电子	1,300	7,657.00	0.06

361	601789	宁波建工	1,600	7,616.00	0.06
362	000099	中信海直	1,100	7,601.00	0.06
363	601330	绿色动力	800	7,600.00	0.06
364	600764	中国海防	300	7,590.00	0.06
365	600468	百利电气	1,488	7,573.92	0.06
366	002935	天奥电子	320	7,571.20	0.06
367	600981	汇鸿集团	2,400	7,536.00	0.06
368	600894	广日股份	1,100	7,535.00	0.06
369	601865	福莱特	400	7,520.00	0.06
370	600626	申达股份	1,500	7,515.00	0.06
371	002518	科士达	600	7,440.00	0.06
372	300276	三丰智能	1,500	7,410.00	0.06
373	600268	国电南自	900	7,371.00	0.06
374	002325	洪涛股份	2,400	7,368.00	0.06
375	300293	蓝英装备	400	7,328.00	0.06
376	600548	深高速	800	7,312.00	0.06
377	600874	创业环保	1,100	7,304.00	0.06
378	000557	西部创业	2,100	7,287.00	0.06
379	300420	五洋停车	1,260	7,270.20	0.06
380	601126	四方股份	1,200	7,260.00	0.06
381	603556	海兴电力	500	7,220.00	0.06
382	300161	华中数控	300	7,194.00	0.06
383	002344	海宁皮城	1,700	7,123.00	0.06
384	300400	劲拓股份	500	7,120.00	0.06
385	600590	泰豪科技	1,320	7,114.80	0.06
386	002519	银河电子	1,700	7,055.00	0.06
387	600794	保税科技	2,300	7,038.00	0.06
388	603359	东珠生态	420	7,026.60	0.06
389	002245	澳洋顺昌	1,800	6,966.00	0.06
390	002829	星网宇达	200	6,958.00	0.06
391	002218	拓日新能	1,900	6,935.00	0.06
392	300545	联得装备	200	6,914.00	0.06
393	600537	亿晶光电	2,200	6,908.00	0.06
394	000520	长航凤凰	1,900	6,897.00	0.06
395	000811	冰轮环境	1,100	6,886.00	0.06
396	002833	弘亚数控	280	6,868.40	0.06
397	603859	能科股份	200	6,832.00	0.06
398	600405	动力源	1,500	6,825.00	0.06
399	002334	英威腾	1,600	6,816.00	0.06
400	603458	勘设股份	325	6,760.00	0.06
401	601515	东风股份	1,100	6,721.00	0.06
402	002452	长高集团	1,000	6,700.00	0.06
403	000928	中钢国际	1,700	6,681.00	0.06
404	002090	金智科技	800	6,680.00	0.06

405	002060	粤水电	2,300	6,647.00	0.06
405	300201	海伦哲	1,700	6,647.00	0.06
406	600058	五矿发展	1,100	6,644.00	0.06
407	603300	华铁应急	1,120	6,641.60	0.06
408	300422	博世科	600	6,582.00	0.05
409	300391	康跃科技	500	6,570.00	0.05
410	603187	海容冷链	180	6,564.60	0.05
411	002229	鸿博股份	900	6,561.00	0.05
412	000055	方大集团	1,500	6,555.00	0.05
413	002559	亚威股份	1,100	6,534.00	0.05
414	002438	江苏神通	800	6,528.00	0.05
414	600805	悦达投资	1,600	6,528.00	0.05
415	000544	中原环保	1,000	6,510.00	0.05
416	601002	晋亿实业	1,200	6,504.00	0.05
417	002685	华东重机	1,100	6,490.00	0.05
418	300193	佳士科技	900	6,435.00	0.05
419	603030	全筑股份	900	6,408.00	0.05
420	300762	上海瀚讯	200	6,380.00	0.05
421	002482	广田集团	1,900	6,365.00	0.05
422	600501	航天晨光	700	6,363.00	0.05
423	002046	轴研科技	600	6,348.00	0.05
424	002796	世嘉科技	300	6,345.00	0.05
425	000906	浙商中拓	1,100	6,336.00	0.05
426	601886	江河集团	1,100	6,325.00	0.05
427	600035	楚天高速	2,100	6,321.00	0.05
428	002564	天沃科技	1,600	6,320.00	0.05
429	000058	深赛格	800	6,288.00	0.05
430	300208	青岛中程	1,000	6,280.00	0.05
431	600826	兰生股份	600	6,276.00	0.05
432	603167	渤海轮渡	800	6,272.00	0.05
433	002606	大连电瓷	800	6,264.00	0.05
434	600218	全柴动力	700	6,244.00	0.05
435	000065	北方国际	850	6,213.50	0.05
436	300215	电科院	1,000	6,180.00	0.05
437	002270	华明装备	1,100	6,160.00	0.05
438	600382	广东明珠	940	6,147.60	0.05
439	002062	宏润建设	1,400	6,146.00	0.05
440	002009	天奇股份	800	6,136.00	0.05
441	002542	中化岩土	1,800	6,120.00	0.05
442	300510	金冠股份	1,386	6,098.40	0.05
443	300503	昊志机电	400	6,096.00	0.05
444	000584	哈工智能	1,100	6,083.00	0.05
445	600710	苏美达	1,400	6,076.00	0.05
446	600313	农发种业	1,700	6,052.00	0.05

447	000005	世纪星源	2,300	6,049.00	0.05
448	002738	中矿资源	400	5,996.00	0.05
449	000922	佳电股份	1,000	5,970.00	0.05
450	300499	高澜股份	500	5,960.00	0.05
451	603959	百利科技	676	5,948.80	0.05
452	603357	设计总院	600	5,940.00	0.05
453	002527	新时达	1,200	5,928.00	0.05
454	002366	台海核电	1,400	5,922.00	0.05
455	300095	华伍股份	600	5,880.00	0.05
456	603169	兰石重装	1,400	5,852.00	0.05
457	603466	风语筑	300	5,841.00	0.05
458	600475	华光环能	500	5,835.00	0.05
459	000498	山东路桥	1,200	5,820.00	0.05
460	300018	中元股份	1,000	5,790.00	0.05
461	600184	光电股份	600	5,784.00	0.05
462	601107	四川成渝	1,700	5,763.00	0.05
463	300569	天能重工	705	5,752.80	0.05
464	603203	快克股份	200	5,738.00	0.05
465	603728	鸣志电器	440	5,737.60	0.05
465	603776	永安行	320	5,737.60	0.05
466	601616	广电电气	1,800	5,706.00	0.05
467	002011	盾安环境	1,500	5,655.00	0.05
468	002560	通达股份	700	5,635.00	0.05
469	300538	同益股份	200	5,620.00	0.05
470	002441	众业达	700	5,593.00	0.05
471	300424	航新科技	416	5,566.08	0.05
472	002297	博云新材	900	5,562.00	0.05
473	300013	新宁物流	1,000	5,550.00	0.05
474	601038	一拖股份	600	5,544.00	0.05
475	300129	泰胜风能	1,500	5,505.00	0.05
476	002622	融钰集团	1,800	5,490.00	0.05
477	600292	远达环保	1,100	5,445.00	0.05
478	300415	伊之密	700	5,439.00	0.05
479	300237	美晨生态	2,520	5,418.00	0.04
480	300281	金明精机	700	5,397.00	0.04
481	300140	中环装备	600	5,388.00	0.04
482	603283	赛腾股份	100	5,380.00	0.04
483	600897	厦门空港	300	5,373.00	0.04
484	600368	五洲交通	1,520	5,320.00	0.04
485	002184	海得控制	400	5,280.00	0.04
485	002533	金杯电工	1,000	5,280.00	0.04
486	603105	芯能科技	600	5,274.00	0.04
487	300021	大禹节水	1,200	5,268.00	0.04
488	601218	吉鑫科技	1,900	5,263.00	0.04

489	002342	巨力索具	1,800	5,256.00	0.04
489	600798	宁波海运	1,800	5,256.00	0.04
490	000068	华控赛格	1,500	5,250.00	0.04
491	002630	华西能源	2,580	5,237.40	0.04
492	000821	京山轻机	900	5,220.00	0.04
492	002178	延华智能	1,200	5,220.00	0.04
493	300757	罗博特科	130	5,200.00	0.04
494	600180	瑞茂通	800	5,104.00	0.04
495	002140	东华科技	780	5,101.20	0.04
496	000576	广东甘化	700	5,089.00	0.04
497	300340	科恒股份	480	5,083.20	0.04
498	601008	连云港	1,500	5,040.00	0.04
499	002628	成都路桥	1,300	5,031.00	0.04
500	300411	金盾股份	500	5,005.00	0.04
501	300690	双一科技	200	5,002.00	0.04
502	000885	城发环境	500	4,995.00	0.04
503	002471	中超控股	2,400	4,992.00	0.04
504	603063	禾望电气	700	4,984.00	0.04
505	300004	南风股份	900	4,968.00	0.04
506	002879	长缆科技	320	4,966.40	0.04
507	300471	厚普股份	600	4,956.00	0.04
508	603618	杭电股份	900	4,950.00	0.04
509	002860	星帅尔	310	4,929.00	0.04
510	002300	太阳电缆	760	4,924.80	0.04
511	603396	金辰股份	180	4,915.80	0.04
512	600278	东方创业	530	4,913.10	0.04
513	300425	中建环能	1,136	4,896.16	0.04
514	002534	杭锅股份	600	4,872.00	0.04
515	000812	陕西金叶	1,700	4,828.00	0.04
516	600853	龙建股份	1,520	4,818.40	0.04
517	002532	新界泵业	600	4,770.00	0.04
518	002689	远大智能	1,400	4,760.00	0.04
519	300228	富瑞特装	1,200	4,728.00	0.04
520	002546	新联电子	1,200	4,716.00	0.04
521	300011	鼎汉技术	800	4,696.00	0.04
522	002757	南兴股份	275	4,688.75	0.04
523	002549	凯美特气	600	4,668.00	0.04
524	300307	慈星股份	1,100	4,664.00	0.04
525	300593	新雷能	300	4,644.00	0.04
526	300195	长荣股份	800	4,632.00	0.04
526	603016	新宏泰	200	4,632.00	0.04
527	002141	贤丰控股	1,500	4,620.00	0.04
528	002751	易尚展示	200	4,544.00	0.04
529	002196	方正电机	900	4,536.00	0.04

530	603131	上海沪工	260	4,531.80	0.04
531	300506	名家汇	900	4,518.00	0.04
532	000905	厦门港务	700	4,515.00	0.04
533	002350	北京科锐	861	4,511.64	0.04
534	300472	新元科技	400	4,456.00	0.04
535	002483	润邦股份	1,000	4,450.00	0.04
536	002818	富森美	360	4,428.00	0.04
537	002761	多喜爱	500	4,420.00	0.04
538	300382	斯莱克	600	4,416.00	0.04
539	603648	畅联股份	500	4,400.00	0.04
540	002769	普路通	600	4,374.00	0.04
541	001872	招商港口	300	4,365.00	0.04
542	603698	航天工程	400	4,352.00	0.04
543	002006	精功科技	900	4,338.00	0.04
544	000151	中成股份	500	4,330.00	0.04
545	600279	重庆港九	1,200	4,320.00	0.04
546	300172	中电环保	900	4,293.00	0.04
547	603901	永创智能	600	4,272.00	0.04
548	000628	高新发展	500	4,265.00	0.04
549	603912	佳力图	200	4,264.00	0.04
550	002451	摩恩电气	600	4,254.00	0.04
551	600113	浙江东日	660	4,224.00	0.04
552	603017	中衡设计	400	4,208.00	0.03
553	002781	奇信股份	300	4,197.00	0.03
554	002801	微光股份	100	4,195.00	0.03
555	002116	中国海诚	600	4,194.00	0.03
556	300265	通光线缆	400	4,184.00	0.03
557	002487	大金重工	700	4,172.00	0.03
558	603069	海汽集团	300	4,158.00	0.03
559	603045	福达合金	300	4,149.00	0.03
560	300262	巴安水务	1,050	4,147.50	0.03
561	603871	嘉友国际	192	4,145.28	0.03
562	300712	永福股份	290	4,132.50	0.03
563	000779	甘咨询	400	4,132.00	0.03
564	300260	新莱应材	200	4,090.00	0.03
565	603200	上海洗霸	100	4,089.00	0.03
566	000833	粤桂股份	900	4,068.00	0.03
567	601177	杭齿前进	500	4,065.00	0.03
568	603066	音飞储存	434	4,053.56	0.03
569	300600	瑞特股份	412	4,045.84	0.03
570	000856	冀东装备	500	4,040.00	0.03
571	002645	华宏科技	500	4,035.00	0.03
572	002682	龙洲股份	1,000	4,030.00	0.03
573	603339	四方科技	300	4,029.00	0.03

574	300447	全信股份	400	4,016.00	0.03
575	603789	星光农机	300	4,011.00	0.03
576	000530	冰山冷热	1,200	4,008.00	0.03
577	002026	山东威达	800	4,000.00	0.03
578	300334	津膜科技	500	3,990.00	0.03
579	603416	信捷电气	100	3,986.00	0.03
580	600822	上海物贸	400	3,968.00	0.03
581	300414	中光防雷	350	3,948.00	0.03
582	002346	柘中股份	400	3,932.00	0.03
583	300599	雄塑科技	300	3,930.00	0.03
583	603535	嘉诚国际	200	3,930.00	0.03
584	603333	尚纬股份	600	3,918.00	0.03
585	603897	长城科技	200	3,896.00	0.03
586	300278	华昌达	1,100	3,894.00	0.03
587	002457	青龙管业	500	3,875.00	0.03
588	002651	利君股份	800	3,872.00	0.03
589	603117	万林物流	1,080	3,844.80	0.03
590	600287	江苏舜天	700	3,843.00	0.03
591	002743	富煌钢构	600	3,804.00	0.03
592	603318	派思股份	500	3,800.00	0.03
593	600192	长城电工	800	3,776.00	0.03
594	603032	德新交运	220	3,740.00	0.03
595	603843	正平股份	780	3,736.20	0.03
596	000701	厦门信达	800	3,736.00	0.03
597	000632	三木集团	900	3,672.00	0.03
598	300778	新城市	125	3,658.75	0.03
599	000626	远大控股	600	3,654.00	0.03
599	600579	克劳斯	700	3,654.00	0.03
600	002823	凯中精密	341	3,641.88	0.03
601	300732	设研院	276	3,632.16	0.03
602	603817	海峡环保	600	3,630.00	0.03
603	002337	赛象科技	1,100	3,619.00	0.03
604	600248	延长化建	900	3,618.00	0.03
605	600152	维科技术	600	3,546.00	0.03
606	603109	神驰机电	100	3,540.00	0.03
607	600175	退市美都	10,700	3,531.00	0.03
608	603929	亚翔集成	200	3,518.00	0.03
609	002933	新兴装备	100	3,509.00	0.03
610	603311	金海环境	300	3,471.00	0.03
611	300719	安达维尔	300	3,462.00	0.03
612	603797	联泰环保	300	3,447.00	0.03
613	603607	京华激光	220	3,421.00	0.03
614	000711	京蓝科技	1,060	3,381.40	0.03
615	300444	双杰电气	901	3,360.73	0.03

616	300617	安靠智电	100	3,360.00	0.03
617	002729	好利来	100	3,334.00	0.03
618	603011	合锻智能	700	3,325.00	0.03
619	603956	威派格	200	3,294.00	0.03
620	002162	悦心健康	1,100	3,289.00	0.03
621	603985	恒润股份	200	3,282.00	0.03
622	300187	永清环保	700	3,269.00	0.03
623	300800	力合科技	100	3,266.00	0.03
624	603828	柯利达	700	3,255.00	0.03
625	300490	华自科技	400	3,240.00	0.03
626	603988	中电电机	248	3,221.52	0.03
627	002949	华阳国际	200	3,220.00	0.03
628	603126	中材节能	800	3,208.00	0.03
629	300718	长盛轴承	200	3,182.00	0.03
630	300105	龙源技术	800	3,176.00	0.03
631	300669	沪宁股份	100	3,161.00	0.03
632	002892	科力尔	140	3,154.20	0.03
633	300407	凯发电气	400	3,144.00	0.03
634	601068	中铝国际	800	3,128.00	0.03
635	600281	太化股份	800	3,096.00	0.03
636	300437	清水源	300	3,090.00	0.03
637	002593	日上集团	900	3,087.00	0.03
638	603577	汇金通	300	3,081.00	0.03
639	603915	国茂股份	200	3,074.00	0.03
640	603970	中农立华	208	3,063.84	0.03
641	300475	聚隆科技	360	3,063.60	0.03
642	300103	达刚控股	350	3,045.00	0.03
643	300500	启迪设计	220	3,020.60	0.03
644	603937	丽岛新材	200	3,010.00	0.02
645	002786	银宝山新	400	2,980.00	0.02
646	603289	泰瑞机器	300	2,964.00	0.02
646	603966	法兰泰克	300	2,964.00	0.02
647	300797	钢研纳克	200	2,962.00	0.02
648	300635	中达安	100	2,919.00	0.02
649	300430	诚益通	400	2,908.00	0.02
650	002552	宝鼎科技	200	2,888.00	0.02
651	603967	中创物流	200	2,886.00	0.02
652	002887	绿茵生态	235	2,862.30	0.02
653	603530	神马电力	100	2,831.00	0.02
654	300344	太空智造	700	2,807.00	0.02
655	002227	奥特迅	200	2,806.00	0.02
656	002514	宝馨科技	700	2,800.00	0.02
657	300711	广哈通信	232	2,772.40	0.02
658	300117	嘉寓股份	1,000	2,770.00	0.02

659	002795	永和智控	200	2,760.00	0.02
659	603603	博天环境	400	2,760.00	0.02
660	002599	盛通股份	700	2,758.00	0.02
661	002882	金龙羽	300	2,751.00	0.02
662	002903	宇环数控	200	2,732.00	0.02
663	603616	韩建河山	400	2,712.00	0.02
664	002927	泰永长征	216	2,693.52	0.02
665	300240	飞力达	500	2,645.00	0.02
666	300675	建科院	200	2,632.00	0.02
667	300564	筑博设计	100	2,630.00	0.02
668	300581	晨曦航空	180	2,613.60	0.02
669	300154	瑞凌股份	500	2,590.00	0.02
670	300385	雪浪环境	400	2,548.00	0.02
671	300697	电工合金	190	2,528.90	0.02
672	300594	朗进科技	100	2,500.00	0.02
673	300772	运达股份	200	2,470.00	0.02
674	002877	智能自控	340	2,461.60	0.02
675	002963	豪尔赛	100	2,448.00	0.02
676	002957	科瑞技术	100	2,390.00	0.02
677	002972	科安达	100	2,383.00	0.02
678	300589	江龙船艇	200	2,358.00	0.02
679	300746	汉嘉设计	200	2,346.00	0.02
680	002973	侨银环保	100	2,344.00	0.02
681	300536	农尚环境	300	2,334.00	0.02
682	300491	通合科技	200	2,322.00	0.02
683	002889	东方嘉盛	100	2,317.00	0.02
684	002943	宇晶股份	100	2,299.00	0.02
685	002040	南京港	370	2,294.00	0.02
686	300722	新余国科	134	2,275.32	0.02
687	300775	三角防务	100	2,164.00	0.02
688	300795	米奥会展	100	2,157.00	0.02
689	603819	神力股份	200	2,120.00	0.02
690	603321	梅轮电梯	300	2,109.00	0.02
691	603815	交建股份	100	2,085.00	0.02
692	603778	乾景园林	600	2,052.00	0.02
693	603279	景津环保	100	2,049.00	0.02
694	300621	维业股份	200	2,010.00	0.02
695	002774	快意电梯	300	2,004.00	0.02
696	300809	华辰装备	100	1,980.00	0.02
697	603085	天成自控	280	1,974.00	0.02
698	600463	空港股份	300	1,953.00	0.02
699	002931	锋龙股份	120	1,940.40	0.02
700	300779	惠城环保	100	1,881.00	0.02
701	002164	宁波东力	600	1,860.00	0.02

702	300670	大烨智能	300	1,833.00	0.02
703	002951	金时科技	100	1,780.00	0.01
704	300780	德恩精工	100	1,751.00	0.01
705	603500	祥和实业	120	1,722.00	0.01
706	002871	伟隆股份	100	1,662.00	0.01
707	002856	美芝股份	100	1,614.00	0.01
708	300488	恒锋工具	100	1,465.00	0.01
709	002941	新疆交建	100	1,415.00	0.01
710	603617	君禾股份	100	1,030.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002352	顺丰控股	86,944.00	0.42
2	601766	中国中车	86,540.00	0.42
3	601668	中国建筑	83,237.00	0.41
4	600031	三一重工	77,242.00	0.38
5	601012	隆基股份	64,868.00	0.32
6	601800	中国交建	64,387.00	0.31
7	600009	上海机场	54,684.00	0.27
8	601390	中国中铁	51,363.00	0.25
9	002340	格林美	46,812.00	0.23
10	002414	高德红外	46,687.00	0.23
11	601816	京沪高铁	45,000.00	0.22
12	600233	圆通速递	41,036.00	0.20
13	600406	国电南瑞	35,956.00	0.17
14	601186	中国铁建	32,096.00	0.16
15	601006	大秦铁路	32,032.00	0.16
16	601989	中国重工	31,484.00	0.15
17	601877	正泰电器	29,642.00	0.14
18	600029	南方航空	27,456.00	0.13
19	002120	韵达股份	26,917.00	0.13
20	601669	中国电建	23,576.00	0.11

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，不包括因投资者申购赎回基

金份额导致的基金组合中股票的增减。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600031	三一重工	140,765.00	0.69
2	601668	中国建筑	132,592.00	0.65
3	601012	隆基股份	118,663.00	0.58
4	600009	上海机场	92,808.00	0.45
5	601766	中国中车	72,584.00	0.35
6	600406	国电南瑞	58,684.00	0.29
7	601006	大秦铁路	52,179.00	0.25
8	601186	中国铁建	49,542.00	0.24
9	601800	中国交建	48,434.00	0.24
10	601989	中国重工	46,403.00	0.23
11	601390	中国中铁	44,486.00	0.22
12	600018	上港集团	42,744.00	0.21
13	300750	宁德时代	41,793.00	0.20
14	600120	浙江东方	35,251.20	0.17
15	601669	中国电建	33,296.00	0.16
16	600089	特变电工	32,112.00	0.16
17	603638	艾迪精密	30,750.00	0.15
18	603338	浙江鼎力	30,128.00	0.15
19	601877	正泰电器	30,080.00	0.15
20	601717	郑煤机	29,952.00	0.15

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,535,183.11
卖出股票收入（成交）总额	4,482,115.25

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,755.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,755.40	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110069	瀚蓝转债	30	3,755.40	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，惠州亿纬锂能股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国惠州海关的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,107.78
2	应收证券清算款	25,641.27
3	应收股利	-
4	应收利息	101.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,850.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		广发中证全指工业交易型 开放式指数证券投资基金 发起式联接基金	
		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
641	23,660.56	1,805,828.00	11.91%	13,360,593.00	88.09%	0.00	0.00%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	赵翔	2,999,174.00	19.78%
2	福建天之成投资管理有限 公司-天之成9号私募证券 投资基金	1,789,300.00	11.80%
3	周生雷	414,264.00	2.73%
4	欧阳珮	409,400.00	2.70%
5	何朗	352,152.00	2.32%
6	张小宁	200,046.00	1.32%
7	兰旭东	200,015.00	1.32%
8	邓燕姝	200,015.00	1.32%
9	曹美郴	160,010.00	1.06%
10	吕宁	150,029.00	0.99%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年6月13日）基金份额总额	291,166,421.00
本报告期期初基金份额总额	27,166,421.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,166,421.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	55,428.00	0.79%	40.51	0.75%	-
广发证券	3	1,593,558.57	22.71%	1,464.56	26.97%	-
中信证券	3	1,808,126.40	25.77%	1,322.19	24.35%	-
海通证券	2	3,560,185.39	50.73%	2,603.57	47.94%	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华金证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

山西证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	15,868.50	56.98%	-	-	-	-
中信证券	11,979.98	43.02%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-

东莞证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-21
2	关于增加中信证券（华南）为旗下部分基金场外申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-20
3	关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金调整标的指数许可使用费并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-31
4	广发基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27
5	关于增加东吴证券为旗下部分基金场内申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-09
6	关于旗下基金调整申购（含定期定额投资）及转换转入确认业务规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-28
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-17
8	根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 41 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-11

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指	1	20200101-20200618	12,587,457.00	230,000.00	12,817,457.00	-	-

工业交 易型开 放式指 数证 券投 资基 金发 起 式联 接 基金							
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，本公司于本报告期内对本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件进行了信息披露相关条款的修订。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 41 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》。

2、根据中证指数有限公司下发的《关于国内市场 A 股 ETF 收费调整的通知》及基金合同的有关规定，本基金管理人经与相关托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定调整本基金标的指数许可使用费，并相应修订基金合同。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金调整标的指数许可使用费并修订基金合同的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司
二〇二〇年八月二十七日