

广发中证 800 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 13 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	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.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
8 基金份额持有人信息	59

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
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	60
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	60
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	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8	其他重大事件	66
11	影响投资者决策的其他重要信息	66
12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	159802
交易代码	159802
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 13 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,524,620.00 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	2020 年 5 月 15 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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
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 90%。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588

传真	020-89899158	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日）
本期已实现收益	1,124,373.38
本期利润	3,554,873.59
加权平均基金份额本期利润	0.0245
本期加权平均净值利润率	2.44%
本期基金份额净值增长率	6.10%
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	1,067,114.84
期末可供分配基金份额利润	0.0220
期末基金资产净值	51,483,268.40
期末基金份额净值	1.0610
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	6.10%

注：（1）本基金合同生效日为2020年4月13日，至披露时点不满半年。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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）。

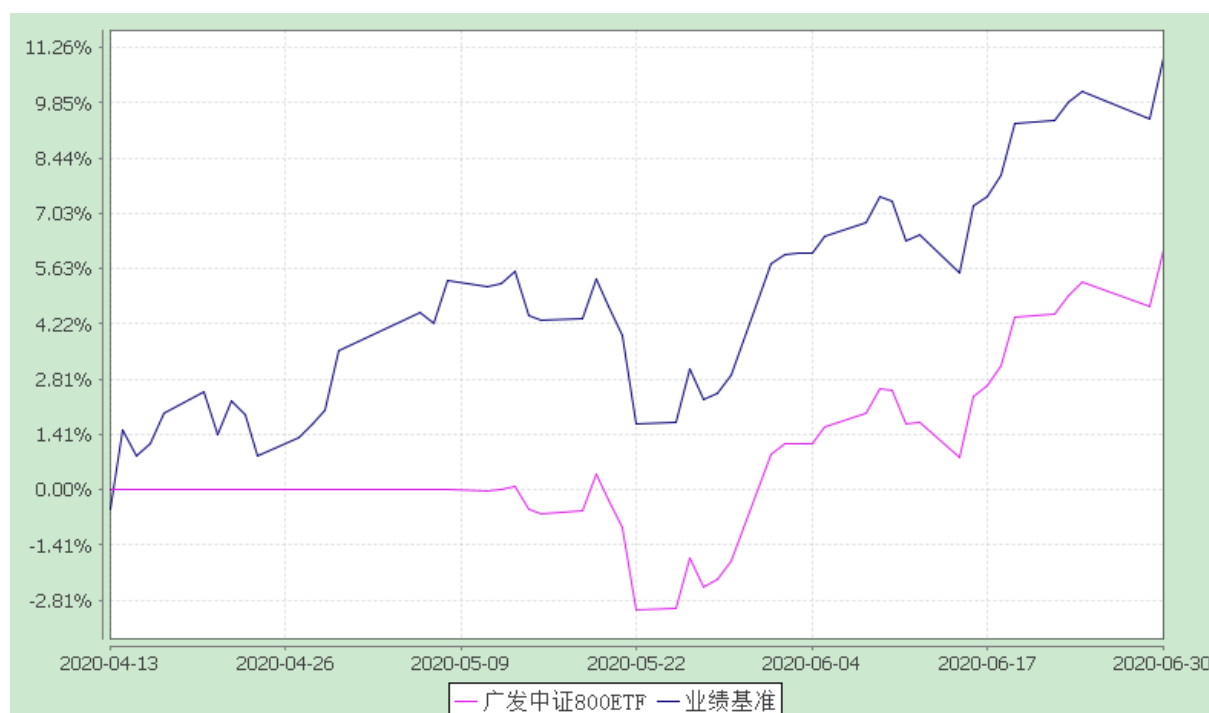
3.2 基金净值表现

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	8.04%	0.84%	7.87%	0.87%	0.17%	-0.03%
自基金合同生效起至今	6.10%	0.70%	11.00%	0.87%	-4.90%	-0.17%

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 800 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
 （2020 年 4 月 13 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：（1）本基金合同生效日期为 2020 年 4 月 13 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗国庆	本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；广发中	2020-04-13	-	11 年	罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100

	<p>证医疗指数分级证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基</p>				<p>指数分级证券投资基金基金经理 (自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)。</p>
--	---	--	--	--	--

	金经理；指数 投资部副总经 理				
--	-----------------------	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中证 800 指数样本股由沪深 300 和中证 500 指数样本股构成，反映 A 股中较大市值的股票的价格表现。作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，按照指数结构进行复制，指数样本采用完全复制法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2020 年上半年，A 股市场整体震荡上行，结构分化明显。沪深 300 指数上涨 1.64%，中证 500 指数上涨 11.33%，创业板指数上涨 35.60%，中证 800 指数上涨 3.94%。市场整体上涨原因有以下三点：（1）在疫情影响下，中国经济比其他海外经济体更有韧性，中国经济复苏更为明确，中国的股票资产性价比更高。（2）国内货币财政政策对经济的托底作用显现。今年上半年以来，随着统筹推进疫情防控和经济社会发展的成效继续显现，复工、复产、复商、复市全面推进，国内生产需求继续改善，就业和物价总体平稳，经济继续呈现恢复态势。（3）银行理财收益率不断下行，债券基金以及货币基金收益率持续下降，居民大类资产配置的需求也发生变化，权益资产吸引力增加。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 6.10%，同期业绩比较基准收益率为 11.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方

面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 800 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 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	3,800,280.16
结算备付金		2,566,715.02
存出保证金		72,150.52
交易性金融资产	6.4.7.2	49,521,766.77
其中：股票投资		49,521,766.77
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	1,176.54
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	78,706.96
资产总计		56,040,795.97
负债和所有者权益	附注号	本期末

2020 年 6 月 30 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		1,192,401.76
应付赎回款		-
应付管理人报酬		8,277.69
应付托管费		2,759.23
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	345,356.32
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	3,008,732.57
负债合计		4,557,527.57
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	48,524,620.00
未分配利润	6.4.7.10	2,958,648.40
所有者权益合计		51,483,268.40
负债和所有者权益总计		56,040,795.97

注:(1)报告截止日 2020 年 6 月 30 日,基金份额净值人民币 1.0610 元,基金份额总额 48,524,620.00 份。

(2) 本会计期间为 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体: 广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,248,545.93
1.利息收入		117,758.60
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	117,756.73
债券利息收入		1.87
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）		1,484,280.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	841,145.25
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	3,164.56
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	639,970.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,430,500.21
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	216,006.71
减：二、费用		693,672.34
1. 管理人报酬		45,947.99
2. 托管费		15,315.97
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	526,468.75
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	105,939.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,554,873.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,554,873.59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）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）	222,524,620.00	-	222,524,620.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,554,873.59	3,554,873.59
三、本期基金份额交易产	-174,000,000.00	-596,225.19	-174,596,225.19

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	33,000,000.00	48,572.62	33,048,572.62
2.基金赎回款	-207,000,000.00	-644,797.81	-207,644,797.81
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）	48,524,620.00	2,958,648.40	51,483,268.40

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 800 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[2019]2908 号《关于准予广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2020 年 3 月 23 日向社会公开发行募集并于 2020 年 4 月 13 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2020 年 3 月 23 日至 2020 年 4 月 3 日，为交易型开放式基金，存续期限不定，募集金额总额为人民币 222,524,620.00 元，有效认购户数为 3,361 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 15,403.00 元，折合基金份额 15,403.00 份。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集金额经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

（2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公

允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵

销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司

代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见《招募说明书》；

2、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；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；

- 3、本基金的收益分配采取现金分红的方式；
- 4、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人、登记结算机构可对基金收益分配原则进行调整，并及时公告，而不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

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	3,800,280.16
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	3,800,280.16

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	47,091,266.56	49,521,766.77	2,430,500.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	47,091,266.56	49,521,766.77	2,430,500.21

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	177.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	29.25
应收结算备付金利息	970.24
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,176.54

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-

待摊费用	78,706.96
合计	78,706.96

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	345,356.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	345,356.32

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	41,316.97
应付替代款	2,937,030.98
应付指数使用费	30,384.62
合计	3,008,732.57

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	222,524,620.00	222,524,620.00
本期申购	33,000,000.00	33,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-207,000,000.00	-207,000,000.00
本期末	48,524,620.00	48,524,620.00

注：本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额情况，详见于附注 6.4.1“基金基本情况”之说明。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,124,373.38	2,430,500.21	3,554,873.59
本期基金份额交易产生的变动数	-57,258.54	-538,966.65	-596,225.19
其中：基金申购款	8,065.35	40,507.27	48,572.62

基金赎回款	-65,323.89	-579,473.92	-644,797.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,067,114.84	1,891,533.56	2,958,648.40

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	114,460.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	91.22
结算备付金利息收入	3,204.83
其他	-
合计	117,756.73

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 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	586,311.74
股票投资收益——赎回差价收入	254,833.51
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	841,145.25

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 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	145,406,478.56
减：卖出股票成本总额	144,820,166.82
买卖股票差价收入	586,311.74

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 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	207,644,797.81
减：现金支付赎回款总额	130,601,814.81
减：赎回股票成本总额	76,788,149.49

赎回差价收入	254,833.51
--------	------------

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4月13日（基金合同生效日）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	3,164.56
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	3,164.56

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4月13日（基金合同生效日）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	11,366.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,200.00
减：应收利息总额	1.87
买卖债券差价收入	3,164.56

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4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	639,970.60
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	639,970.60

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4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	2,430,500.21
——股票投资	2,430,500.21

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	2,430,500.21

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	1,463.94
替代损益	214,542.77
合计	216,006.71

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4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	526,468.75
银行间市场交易费用	-
合计	526,468.75

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	10,213.12
信息披露费	27,034.59
证券出借违约金	-
银行汇划费	45.00
指数使用费	30,384.62
其他	38,262.30

合计	105,939.63
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
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
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东

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4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	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	69,688,121.08	17.33%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	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	8,200.00	41.91%

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4月13日（基金合同生效日）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	64,880.99	18.79%	64,880.99	18.79%

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4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	45,947.99
其中：支付销售机构的客户维护费	87.32

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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 2020年4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,315.97

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	3,354,735.00	6.91%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020年4月13日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,800,280.16	114,460.68

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有 7,300 股基金管理人控股股东广发证券股份有限公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 98,916.90 元，估值总额为 103,076.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.20%。本基金本报告期末持有 1,800 股基金管理人股东烽火通信科技股份有限公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 61,211.03 元，估值总额为 52,038.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.10%。本基金本报告期末持有 90,100 股本基金托管人中国工商银行股份有限公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 467,158.85 元，估值总额为 448,698.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.87%。

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

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
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股流通受限	5.00	6.54	1,740.00	8,700.00	11,379.60	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-

注：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债券和权证。

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
002470	*ST 金正	2020-06-30	重大事项停牌	2.27	2020-07-01	2.16	3,900.00	9,711.23	8,853.00	-
601880	大连港	2020-06-22	重大事项停牌	1.72	2020-07-08	1.89	8,500.00	14,732.64	14,620.00	-

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。本基金本报告期末未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基

金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

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

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	3,800,280.16	-	-	-	3,800,280.16

结算备付金	2,566,715.02	-	-	-	2,566,715.02
存出保证金	72,150.52	-	-	-	72,150.52
交易性金融资产	-	-	-	49,521,766.77	49,521,766.77
应收利息	-	-	-	1,176.54	1,176.54
其他资产	-	-	-	78,706.96	78,706.96
资产总计	6,439,145.70	-	-	49,601,650.27	56,040,795.97
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	1,192,401.76	1,192,401.76
应付管理人报酬	-	-	-	8,277.69	8,277.69
应付托管费	-	-	-	2,759.23	2,759.23
应付交易费用	-	-	-	345,356.32	345,356.32
其他负债	-	-	-	3,008,732.57	3,008,732.57
负债总计	-	-	-	4,557,527.57	4,557,527.5
					7
利率敏感度缺口	6,439,145.70	-	-	45,044,122.70	51,483,268.40

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有外汇投资，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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	49,521,766.77	96.19
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	-	-
合计	49,521,766.77	96.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2020 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	2,522,680.15
	业绩比较基准下降 5%	-2,522,680.15

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 49,490,007.67 元，属于第二层次的余额为人民币 31,759.10 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	49,521,766.77	88.37
	其中：股票	49,521,766.77	88.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,366,995.18	11.36
8	其他各项资产	152,034.02	0.27
9	合计	56,040,795.97	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	671,500.00	1.30
B	采矿业	1,189,104.00	2.31
C	制造业	25,058,176.19	48.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,038,965.28	2.02
E	建筑业	889,234.00	1.73

F	批发和零售业	1,097,595.40	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	1,291,861.00	2.51
H	住宿和餐饮业	40,644.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,950,826.10	5.73
J	金融业	11,101,136.40	21.56
K	房地产业	1,816,054.40	3.53
L	租赁和商务服务业	771,823.00	1.50
M	科学研究和技术服务业	337,080.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	115,917.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	59,488.50	0.12
Q	卫生和社会工作	549,002.50	1.07
R	文化、体育和娱乐业	437,685.00	0.85
S	综合	105,674.00	0.21
	合计	49,521,766.77	96.19

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	601318	中国平安	26,754	1,910,235.60	3.71
2	600519	贵州茅台	1,200	1,755,456.00	3.41
3	600036	招商银行	25,500	859,860.00	1.67
4	600276	恒瑞医药	9,154	844,914.20	1.64
5	000858	五粮液	4,800	821,376.00	1.60
6	000333	美的集团	12,100	723,459.00	1.41
7	000651	格力电器	11,900	673,183.00	1.31
8	002475	立讯精密	10,349	531,421.15	1.03
9	600030	中信证券	21,100	508,721.00	0.99
10	601166	兴业银行	30,800	486,024.00	0.94

11	600887	伊利股份	15,000	466,950.00	0.91
12	601398	工商银行	90,100	448,698.00	0.87
13	000002	万 科 A	16,800	439,152.00	0.85
14	600900	长江电力	21,800	412,892.00	0.80
15	601888	中国中免	2,400	369,672.00	0.72
16	601328	交通银行	67,900	348,327.00	0.68
17	300059	东方财富	16,040	324,008.00	0.63
18	002714	牧原股份	3,900	319,800.00	0.62
19	000725	京东方 A	67,000	312,890.00	0.61
20	600585	海螺水泥	5,900	312,169.00	0.61
21	000001	平安银行	24,000	307,200.00	0.60
22	600000	浦发银行	29,000	306,820.00	0.60
23	000661	长春高新	700	304,710.00	0.59
24	600016	民生银行	52,600	298,242.00	0.58
25	603288	海天味业	2,360	293,584.00	0.57
26	002415	海康威视	9,200	279,220.00	0.54
27	600031	三一重工	14,600	273,896.00	0.53
28	601688	华泰证券	14,500	272,600.00	0.53
29	000063	中兴通讯	6,700	268,871.00	0.52
30	601012	隆基股份	6,600	268,818.00	0.52
31	600048	保利地产	17,700	261,606.00	0.51
32	600837	海通证券	20,000	251,600.00	0.49
33	600570	恒生电子	2,300	247,710.00	0.48
34	601668	中国建筑	51,900	247,563.00	0.48
35	603259	药明康德	2,560	247,296.00	0.48
36	300498	温氏股份	11,060	241,108.00	0.47
37	601288	农业银行	71,000	239,980.00	0.47
38	300015	爱尔眼科	4,930	214,208.50	0.42
39	601601	中国太保	7,800	212,550.00	0.41
40	000100	TCL 科技	33,400	207,080.00	0.40
41	601229	上海银行	24,600	204,180.00	0.40
42	300142	沃森生物	3,800	198,968.00	0.39
43	600309	万华化学	3,900	194,961.00	0.38
44	002142	宁波银行	7,400	194,398.00	0.38
45	601211	国泰君安	11,200	193,312.00	0.38
46	603986	兆易创新	800	188,728.00	0.37
47	601988	中国银行	52,100	181,308.00	0.35
48	002352	顺丰控股	3,300	180,510.00	0.35
49	601169	北京银行	36,600	179,340.00	0.35
50	000876	新 希 望	6,000	178,800.00	0.35
51	600588	用友网络	3,970	175,077.00	0.34
52	000568	泸州老窖	1,900	173,128.00	0.34
53	600009	上海机场	2,400	172,968.00	0.34
54	002594	比亚迪	2,400	172,320.00	0.33

55	601766	中国中车	30,100	167,657.00	0.33
56	002410	广联达	2,400	167,280.00	0.32
57	600690	海尔智家	9,400	166,380.00	0.32
58	002241	歌尔股份	5,600	164,416.00	0.32
59	000338	潍柴动力	11,800	161,896.00	0.31
60	002230	科大讯飞	4,300	160,949.00	0.31
61	300122	智飞生物	1,600	160,240.00	0.31
62	002304	洋河股份	1,500	157,710.00	0.31
63	600999	招商证券	7,100	155,845.00	0.30
64	600104	上汽集团	8,996	152,842.04	0.30
65	600703	三安光电	6,000	150,000.00	0.29
66	601899	紫金矿业	34,000	149,600.00	0.29
67	002555	三七互娱	3,100	145,080.00	0.28
68	002027	分众传媒	25,400	141,478.00	0.27
69	601818	光大银行	39,400	141,052.00	0.27
70	600745	闻泰科技	1,100	138,545.00	0.27
71	002007	华兰生物	2,700	135,297.00	0.26
72	300347	泰格医药	1,300	132,444.00	0.26
73	300601	康泰生物	800	129,728.00	0.25
74	600028	中国石化	33,100	129,421.00	0.25
75	600919	江苏银行	22,800	129,276.00	0.25
76	001979	招商蛇口	7,800	128,232.00	0.25
77	000538	云南白药	1,300	121,953.00	0.24
78	601009	南京银行	16,500	120,945.00	0.23
79	300014	亿纬锂能	2,502	119,720.70	0.23
80	601088	中国神华	8,300	119,188.00	0.23
81	600436	片仔癀	700	119,175.00	0.23
82	300413	芒果超媒	1,800	117,360.00	0.23
83	600547	山东黄金	3,200	117,184.00	0.23
84	600406	国电南瑞	5,700	115,425.00	0.22
85	000895	双汇发展	2,500	115,225.00	0.22
86	300003	乐普医疗	3,100	113,212.00	0.22
87	000166	申万宏源	22,300	112,615.00	0.22
88	002129	中环股份	5,000	112,300.00	0.22
89	601628	中国人寿	4,100	111,561.00	0.22
90	603160	汇顶科技	500	111,450.00	0.22
91	300136	信维通信	2,100	111,342.00	0.22
92	600050	中国联通	23,000	111,320.00	0.22
93	600438	通威股份	6,400	111,232.00	0.22
94	002271	东方雨虹	2,700	109,701.00	0.21
95	000938	紫光股份	2,500	107,450.00	0.21
96	002460	赣锋锂业	2,000	107,140.00	0.21
97	601939	建设银行	16,600	104,746.00	0.20
98	600015	华夏银行	17,100	104,652.00	0.20

99	601857	中国石油	24,900	104,331.00	0.20
100	601006	大秦铁路	14,700	103,488.00	0.20
101	000776	广发证券	7,300	103,076.00	0.20
102	002371	北方华创	600	102,546.00	0.20
103	601336	新华保险	2,300	101,844.00	0.20
104	600196	复星医药	3,000	101,550.00	0.20
105	603501	韦尔股份	500	100,975.00	0.20
106	601390	中国中铁	20,100	100,902.00	0.20
107	002044	美年健康	7,000	100,870.00	0.20
108	600019	宝钢股份	22,100	100,776.00	0.20
109	002311	海大集团	2,100	99,939.00	0.19
110	603019	中科曙光	2,600	99,840.00	0.19
111	300124	汇川技术	2,600	98,774.00	0.19
112	000977	浪潮信息	2,500	97,950.00	0.19
113	002050	三花智控	4,460	97,674.00	0.19
114	002821	凯莱英	400	97,200.00	0.19
115	300253	卫宁健康	4,210	96,577.40	0.19
116	601186	中国铁建	11,500	96,370.00	0.19
117	002602	世纪华通	6,200	94,922.00	0.18
118	601933	永辉超市	10,100	94,738.00	0.18
119	002001	新 和 成	3,200	93,120.00	0.18
120	300433	蓝思科技	3,300	92,532.00	0.18
121	002624	完美世界	1,600	92,224.00	0.18
122	601989	中国重工	22,500	90,000.00	0.17
123	002127	南极电商	4,200	88,914.00	0.17
124	600958	东方证券	9,200	87,308.00	0.17
125	600809	山西汾酒	600	87,000.00	0.17
126	002236	大华股份	4,500	86,445.00	0.17
127	002456	欧菲光	4,700	86,433.00	0.17
128	300558	贝达药业	600	83,988.00	0.16
129	600352	浙江龙盛	6,500	83,135.00	0.16
130	000157	中联重科	12,900	82,947.00	0.16
131	002008	大族激光	2,300	82,685.00	0.16
132	600183	生益科技	2,800	81,956.00	0.16
133	600739	辽宁成大	4,300	81,399.00	0.16
134	600741	华域汽车	3,900	81,081.00	0.16
135	002024	苏宁易购	9,200	80,684.00	0.16
136	300033	同花顺	600	79,848.00	0.16
137	601377	兴业证券	11,600	79,460.00	0.15
138	601788	光大证券	4,900	78,694.00	0.15
139	600201	生物股份	2,800	77,952.00	0.15
140	601138	工业富联	5,100	77,265.00	0.15
141	002916	深南电路	460	77,059.20	0.15
142	600346	恒力石化	5,500	77,000.00	0.15

143	600383	金地集团	5,600	76,720.00	0.15
144	601155	新城控股	2,400	74,976.00	0.15
145	002463	沪电股份	3,000	74,940.00	0.15
146	000860	顺鑫农业	1,300	74,074.00	0.14
147	002185	华天科技	5,400	73,062.00	0.14
148	600660	福耀玻璃	3,500	73,045.00	0.14
149	601225	陕西煤业	10,100	72,821.00	0.14
150	601901	方正证券	10,200	72,216.00	0.14
151	300408	三环集团	2,600	72,020.00	0.14
152	601877	正泰电器	2,700	71,145.00	0.14
153	300088	长信科技	6,300	70,560.00	0.14
154	002120	韵达股份	2,880	70,416.00	0.14
155	600522	中天科技	6,100	69,845.00	0.14
156	002202	金风科技	7,000	69,790.00	0.14
157	600529	山东药玻	1,200	69,600.00	0.14
158	002736	国信证券	6,100	68,930.00	0.13
159	600340	华夏幸福	3,000	68,580.00	0.13
160	000425	徐工机械	11,600	68,556.00	0.13
161	600109	国金证券	6,000	68,460.00	0.13
162	000069	华侨城 A	11,200	67,872.00	0.13
163	002439	启明星辰	1,600	67,312.00	0.13
164	300012	华测检测	3,400	67,184.00	0.13
165	300285	国瓷材料	2,000	67,020.00	0.13
166	603993	洛阳钼业	18,200	66,794.00	0.13
167	002385	大北农	7,300	66,503.00	0.13
168	300144	宋城演艺	3,840	66,432.00	0.13
169	603799	华友钴业	1,700	66,062.00	0.13
170	601669	中国电建	19,000	65,740.00	0.13
171	603658	安图生物	400	64,976.00	0.13
172	000783	长江证券	9,600	64,704.00	0.13
173	600867	通化东宝	3,700	64,491.00	0.13
174	002131	利欧股份	16,700	64,462.00	0.13
175	601800	中国交建	8,700	63,858.00	0.12
176	603369	今世缘	1,600	63,664.00	0.12
177	601108	财通证券	6,200	63,550.00	0.12
178	601985	中国核电	15,400	62,986.00	0.12
179	601555	东吴证券	7,700	62,832.00	0.12
180	603882	金域医学	700	62,650.00	0.12
181	600079	人福医药	2,300	62,606.00	0.12
182	300482	万孚生物	600	62,400.00	0.12
183	600089	特变电工	9,200	62,284.00	0.12
184	000768	中航飞机	3,500	62,090.00	0.12
185	600010	包钢股份	56,300	60,804.00	0.12
186	600521	华海药业	1,790	60,734.70	0.12

187	000963	华东医药	2,400	60,720.00	0.12
188	600487	亨通光电	3,700	60,717.00	0.12
189	002841	视源股份	600	59,712.00	0.12
190	002465	海格通信	4,600	59,524.00	0.12
191	600298	安琪酵母	1,200	59,376.00	0.12
192	600143	金发科技	4,500	59,265.00	0.12
193	600161	天坛生物	1,300	58,929.00	0.11
194	600061	国投资本	4,600	58,558.00	0.11
195	002493	荣盛石化	4,700	57,810.00	0.11
196	002179	中航光电	1,400	57,414.00	0.11
197	000066	中国长城	4,300	56,760.00	0.11
198	603517	绝味食品	800	56,592.00	0.11
199	603939	益丰药房	620	56,420.00	0.11
200	002074	国轩高科	2,100	56,364.00	0.11
201	600029	南方航空	10,900	56,353.00	0.11
202	600893	航发动力	2,400	56,352.00	0.11
203	601100	恒立液压	700	56,140.00	0.11
204	002212	南洋股份	2,100	55,818.00	0.11
205	600606	绿地控股	9,000	55,620.00	0.11
206	300595	欧普康视	800	55,472.00	0.11
207	002466	天齐锂业	2,400	55,080.00	0.11
208	002075	沙钢股份	4,400	55,000.00	0.11
209	603444	吉比特	100	54,901.00	0.11
210	002223	鱼跃医疗	1,500	54,600.00	0.11
211	000009	中国宝安	6,400	54,464.00	0.11
212	300496	中科创达	700	54,390.00	0.11
213	600886	国投电力	6,900	54,234.00	0.11
214	002157	正邦科技	3,100	54,188.00	0.11
215	000625	长安汽车	4,900	53,900.00	0.10
216	600795	国电电力	29,100	53,835.00	0.10
217	000988	华工科技	2,200	53,746.00	0.10
218	601607	上海医药	2,900	53,302.00	0.10
219	601099	太平洋	16,800	53,256.00	0.10
220	600705	中航资本	13,300	52,668.00	0.10
221	600926	杭州银行	5,900	52,628.00	0.10
222	601128	常熟银行	7,000	52,570.00	0.10
223	000636	风华高科	1,800	52,542.00	0.10
224	002422	科伦药业	2,500	52,500.00	0.10
225	300418	昆仑万维	2,100	52,416.00	0.10
226	601162	天风证券	8,600	52,116.00	0.10
227	600498	烽火通信	1,800	52,038.00	0.10
228	002273	水晶光电	3,000	51,420.00	0.10
229	300315	掌趣科技	7,000	51,310.00	0.10
230	600426	华鲁恒升	2,900	51,272.00	0.10

231	601066	中信建投	1,300	51,194.00	0.10
232	600132	重庆啤酒	700	51,100.00	0.10
233	300207	欣旺达	2,700	51,030.00	0.10
234	601799	星宇股份	400	50,800.00	0.10
235	002507	涪陵榨菜	1,400	50,414.00	0.10
236	603233	大参林	620	50,356.40	0.10
237	600111	北方稀土	5,400	50,328.00	0.10
238	300357	我武生物	800	49,800.00	0.10
239	600176	中国巨石	5,400	49,410.00	0.10
240	600637	东方明珠	5,100	49,215.00	0.10
241	603899	晨光文具	900	49,140.00	0.10
242	000786	北新建材	2,300	49,059.00	0.10
243	601111	中国国航	7,400	48,914.00	0.10
244	300168	万达信息	2,200	48,554.00	0.09
245	002607	中公教育	1,726	47,896.50	0.09
246	300628	亿联网络	700	47,782.00	0.09
247	002340	格林美	9,500	47,215.00	0.09
248	600115	东方航空	11,100	46,842.00	0.09
249	002603	以岭药业	1,500	46,785.00	0.09
250	002500	山西证券	7,140	46,695.60	0.09
251	603833	欧派家居	400	46,360.00	0.09
252	002601	龙蟠佰利	2,500	46,250.00	0.09
253	600118	中国卫星	1,500	46,245.00	0.09
254	600011	华能国际	10,900	45,998.00	0.09
255	601360	三六零	2,500	45,775.00	0.09
256	002373	千方科技	1,900	45,581.00	0.09
257	601816	京沪高铁	7,300	45,479.00	0.09
258	000975	银泰黄金	2,900	45,472.00	0.09
258	600271	航天信息	2,800	45,472.00	0.09
259	601727	上海电气	9,000	45,360.00	0.09
260	600332	白云山	1,400	45,262.00	0.09
261	600699	均胜电子	1,900	45,239.00	0.09
262	300271	华宇软件	1,600	45,136.00	0.09
262	600233	圆通速递	3,100	45,136.00	0.09
263	000547	航天发展	3,300	45,111.00	0.09
264	002414	高德红外	1,540	45,091.20	0.09
265	000596	古井贡酒	300	45,072.00	0.09
266	000656	金科股份	5,500	44,880.00	0.09
267	300212	易华录	800	44,800.00	0.09
268	601600	中国铝业	16,200	44,712.00	0.09
269	601618	中国中冶	17,700	44,427.00	0.09
270	600885	宏发股份	1,100	44,132.00	0.09
271	000021	深科技	2,000	43,660.00	0.08
272	002019	亿帆医药	1,900	43,643.00	0.08

273	002353	杰瑞股份	1,400	43,400.00	0.08
274	002557	洽洽食品	800	43,352.00	0.08
275	003816	中国广核	14,600	43,216.00	0.08
276	000513	丽珠集团	900	43,209.00	0.08
277	002252	上海莱士	5,100	43,146.00	0.08
278	002030	达安基因	1,580	43,102.40	0.08
279	601838	成都银行	5,400	42,984.00	0.08
280	000728	国元证券	5,100	42,840.00	0.08
281	300009	安科生物	2,390	42,781.00	0.08
282	002152	广电运通	3,300	42,702.00	0.08
283	600221	海航控股	28,400	42,600.00	0.08
284	002156	通富微电	1,700	42,585.00	0.08
285	300024	机器人	3,100	42,377.00	0.08
286	002797	第一创业	6,100	42,212.00	0.08
287	600489	中金黄金	4,600	42,044.00	0.08
288	600068	葛洲坝	7,000	41,650.00	0.08
289	601919	中远海控	12,000	41,640.00	0.08
290	300017	网宿科技	4,900	41,601.00	0.08
291	002250	联化科技	1,900	41,420.00	0.08
292	000703	恒逸石化	4,520	41,267.60	0.08
293	600486	扬农化工	500	41,250.00	0.08
294	603659	璞泰来	400	41,208.00	0.08
295	600177	雅戈尔	6,900	41,124.00	0.08
296	600859	王府井	900	40,995.00	0.08
297	000961	中南建设	4,600	40,940.00	0.08
298	603338	浙江鼎力	540	40,915.80	0.08
299	000750	国海证券	9,400	40,796.00	0.08
300	600895	张江高科	2,000	40,740.00	0.08
301	600535	天士力	2,500	40,550.00	0.08
302	603858	步长制药	1,400	40,390.00	0.08
303	600801	华新水泥	1,700	40,307.00	0.08
304	600066	宇通客车	3,300	40,260.00	0.08
305	601997	贵阳银行	5,600	40,096.00	0.08
306	002138	顺络电子	1,600	39,920.00	0.08
307	002195	二三四五	14,200	39,902.00	0.08
308	600004	白云机场	2,600	39,624.00	0.08
309	300316	晶盛机电	1,600	39,584.00	0.08
310	600390	五矿资本	5,600	39,536.00	0.08
311	601998	中信银行	7,600	39,140.00	0.08
312	002174	游族网络	1,500	39,120.00	0.08
313	300058	蓝色光标	5,000	39,000.00	0.08
314	300244	迪安诊断	1,100	38,830.00	0.08
315	603707	健友股份	600	38,742.00	0.08
316	002572	索菲亚	1,600	38,672.00	0.08

317	000050	深天马 A	2,500	38,400.00	0.07
318	600380	健康元	2,362	38,358.88	0.07
319	600315	上海家化	800	38,320.00	0.07
320	000998	隆平高科	2,300	38,295.00	0.07
321	300070	碧水源	4,700	38,164.00	0.07
322	600884	杉杉股份	3,225	38,022.75	0.07
323	600037	歌华有线	2,500	38,000.00	0.07
324	600085	同仁堂	1,400	37,968.00	0.07
325	600779	水井坊	600	37,452.00	0.07
326	002508	老板电器	1,200	37,332.00	0.07
327	600167	联美控股	2,600	37,284.00	0.07
328	601198	东兴证券	3,400	37,060.00	0.07
329	000401	冀东水泥	2,300	36,892.00	0.07
330	002690	美亚光电	700	36,820.00	0.07
331	600410	华胜天成	2,700	36,720.00	0.07
332	601881	中国银河	3,200	36,704.00	0.07
333	600667	太极实业	3,100	36,642.00	0.07
334	000623	吉林敖东	2,300	36,179.00	0.07
335	002078	太阳纸业	3,800	36,176.00	0.07
336	002382	蓝帆医疗	1,200	36,132.00	0.07
337	600018	上港集团	8,600	36,120.00	0.07
338	600642	申能股份	6,100	36,051.00	0.07
339	603605	珀莱雅	200	36,004.00	0.07
340	300274	阳光电源	2,500	35,975.00	0.07
341	600155	华创阳安	3,000	35,970.00	0.07
342	600219	南山铝业	17,700	35,931.00	0.07
343	002511	中顺洁柔	1,600	35,680.00	0.07
344	002013	中航机电	4,500	35,550.00	0.07
345	002032	苏泊尔	500	35,500.00	0.07
346	600845	宝信软件	600	35,448.00	0.07
347	600516	方大炭素	5,640	35,419.20	0.07
348	600998	九州通	1,900	35,378.00	0.07
349	601018	宁波港	9,900	35,343.00	0.07
350	002396	星网锐捷	1,000	35,330.00	0.07
351	300010	立思辰	1,800	35,226.00	0.07
352	000630	铜陵有色	18,200	35,126.00	0.07
353	002673	西部证券	4,300	35,088.00	0.07
354	002926	华西证券	3,300	35,079.00	0.07
355	600362	江西铜业	2,600	34,996.00	0.07
356	601231	环旭电子	1,600	34,944.00	0.07
357	000739	普洛药业	1,500	34,935.00	0.07
358	002146	荣盛发展	4,300	34,830.00	0.07
358	600153	建发股份	4,300	34,830.00	0.07
359	600879	航天电子	5,400	34,776.00	0.07

360	600216	浙江医药	1,800	34,668.00	0.07
361	601233	桐昆股份	2,700	34,452.00	0.07
362	600126	杭钢股份	3,300	34,320.00	0.07
363	601319	中国人保	5,300	34,132.00	0.07
364	600170	上海建工	11,000	33,770.00	0.07
365	601878	浙商证券	3,400	33,694.00	0.07
366	600655	豫园股份	3,800	33,668.00	0.07
367	600415	小商品城	6,900	33,603.00	0.07
368	002739	万达电影	2,200	33,594.00	0.07
369	601117	中国化学	6,100	33,428.00	0.06
370	600804	鹏博士	3,700	33,226.00	0.06
371	002281	光迅科技	1,000	32,860.00	0.06
372	600760	中航沈飞	1,000	32,820.00	0.06
373	600811	东方集团	7,300	32,266.00	0.06
374	600848	上海临港	1,500	32,205.00	0.06
375	600369	西南证券	7,000	32,130.00	0.06
376	000686	东北证券	3,800	32,110.00	0.06
377	002268	卫士通	1,500	32,010.00	0.06
378	600297	广汇汽车	10,000	31,900.00	0.06
379	600728	佳都科技	3,500	31,885.00	0.06
380	601021	春秋航空	900	31,716.00	0.06
381	300251	光线传媒	2,900	31,639.00	0.06
382	600208	新湖中宝	10,600	31,588.00	0.06
383	002387	维信诺	2,200	31,416.00	0.06
384	300001	特锐德	1,500	31,410.00	0.06
385	002153	石基信息	800	31,224.00	0.06
386	300618	寒锐钴业	500	31,010.00	0.06
387	603806	福斯特	620	30,944.20	0.06
388	600418	江淮汽车	3,500	30,905.00	0.06
389	600460	士兰微	2,100	30,828.00	0.06
390	600909	华安证券	4,500	30,735.00	0.06
391	001914	招商积余	1,000	30,730.00	0.06
392	002028	思源电气	1,500	30,690.00	0.06
393	002920	德赛西威	500	30,665.00	0.06
394	600674	川投能源	3,300	30,591.00	0.06
395	002958	青农商行	6,900	30,567.00	0.06
396	603866	桃李面包	600	30,534.00	0.06
397	000997	新大陆	1,900	30,362.00	0.06
398	600827	百联股份	2,100	30,345.00	0.06
399	300002	神州泰岳	4,900	30,331.00	0.06
400	601658	邮储银行	6,600	30,162.00	0.06
401	002938	鹏鼎控股	600	30,036.00	0.06
402	603883	老百姓	300	30,012.00	0.06
403	002242	九阳股份	800	29,816.00	0.06

404	002773	康弘药业	600	29,760.00	0.06
405	300115	长盈精密	1,300	29,705.00	0.06
406	002294	信立泰	1,000	29,660.00	0.06
407	600325	华发股份	4,200	29,652.00	0.06
408	300630	普利制药	400	29,580.00	0.06
409	000999	华润三九	1,000	29,190.00	0.06
410	600528	中铁工业	3,300	29,106.00	0.06
411	600446	金证股份	1,500	29,100.00	0.06
412	600598	北大荒	1,800	28,980.00	0.06
413	000581	威孚高科	1,400	28,952.00	0.06
414	600038	中直股份	700	28,749.00	0.06
415	300166	东方国信	2,300	28,543.00	0.06
416	600511	国药股份	700	28,469.00	0.06
417	600260	凯乐科技	2,100	28,392.00	0.06
418	002939	长城证券	2,300	28,336.00	0.06
419	600497	驰宏锌锗	8,200	28,208.00	0.05
420	601179	中国西电	5,800	28,072.00	0.05
421	601689	拓普集团	1,000	27,900.00	0.05
422	600959	江苏有线	7,400	27,824.00	0.05
423	603000	人民网	1,400	27,762.00	0.05
424	600027	华电国际	8,100	27,702.00	0.05
425	600733	北汽蓝谷	4,300	27,649.00	0.05
426	600718	东软集团	2,400	27,600.00	0.05
427	603156	养元饮品	1,280	27,520.00	0.05
428	002317	众生药业	1,600	27,456.00	0.05
429	600256	广汇能源	10,100	27,270.00	0.05
430	601168	西部矿业	4,700	27,260.00	0.05
431	600549	厦门钨业	2,300	27,232.00	0.05
432	002124	天邦股份	2,100	26,985.00	0.05
433	300474	景嘉微	400	26,920.00	0.05
434	603712	七一二	700	26,866.00	0.05
435	002081	金螳螂	3,400	26,724.00	0.05
436	300296	利亚德	4,400	26,708.00	0.05
437	600820	隧道股份	4,700	26,555.00	0.05
438	002670	国盛金控	2,900	26,535.00	0.05
439	000878	云南铜业	2,500	26,525.00	0.05
440	600704	物产中大	6,300	26,523.00	0.05
441	000564	供销大集	5,900	26,491.00	0.05
442	002080	中材科技	1,700	26,350.00	0.05
443	600977	中国电影	2,000	26,260.00	0.05
444	600673	东阳光	3,800	26,258.00	0.05
445	002368	太极股份	600	26,214.00	0.05
446	600839	四川长虹	9,100	26,117.00	0.05
447	002558	巨人网络	1,500	26,100.00	0.05

448	000627	天茂集团	5,000	26,050.00	0.05
449	000800	一汽解放	2,400	25,776.00	0.05
450	601992	金隅集团	8,400	25,704.00	0.05
451	600060	海信视像	2,100	25,515.00	0.05
452	002221	东华能源	2,900	25,491.00	0.05
453	300113	顺网科技	999	25,374.60	0.05
454	000671	阳光城	4,000	25,360.00	0.05
455	600572	康恩贝	4,600	25,300.00	0.05
456	600008	首创股份	8,400	25,284.00	0.05
457	600482	中国动力	1,600	25,120.00	0.05
458	000158	常山北明	2,400	25,056.00	0.05
459	600583	海油工程	5,500	25,025.00	0.05
460	000729	燕京啤酒	3,627	24,844.95	0.05
461	300026	红日药业	4,500	24,840.00	0.05
462	002831	裕同科技	900	24,759.00	0.05
463	600563	法拉电子	400	24,720.00	0.05
464	601633	长城汽车	3,200	24,704.00	0.05
465	002468	申通快递	1,500	24,615.00	0.05
466	600021	上海电力	3,300	24,420.00	0.05
467	600171	上海贝岭	1,400	24,332.00	0.05
468	601966	玲珑轮胎	1,200	24,240.00	0.05
469	000877	天山股份	1,600	24,160.00	0.05
470	002217	合力泰	4,600	24,150.00	0.05
471	603228	景旺电子	680	23,929.20	0.05
472	600967	内蒙一机	2,300	23,897.00	0.05
473	600875	东方电气	2,700	23,895.00	0.05
474	600597	光明乳业	1,600	23,776.00	0.05
475	600862	中航高科	1,400	23,688.00	0.05
476	002709	天赐材料	700	23,653.00	0.05
477	002056	横店东磁	2,100	23,625.00	0.05
478	600580	卧龙电驱	2,100	23,604.00	0.05
479	600567	山鹰纸业	8,000	23,600.00	0.05
480	600881	亚泰集团	8,100	23,571.00	0.05
481	600160	巨化股份	3,400	23,426.00	0.05
482	600064	南京高科	2,400	23,328.00	0.05
483	600094	大名城	3,900	23,205.00	0.05
484	002925	盈趣科技	400	23,176.00	0.05
485	000060	中金岭南	6,200	23,064.00	0.04
486	002458	益生股份	1,500	22,905.00	0.04
487	000090	天健集团	3,300	22,803.00	0.04
488	600026	中远海能	3,500	22,610.00	0.04
489	600645	中源协和	800	22,600.00	0.04
490	002004	华邦健康	4,200	22,596.00	0.04
491	002399	海普瑞	900	22,536.00	0.04

492	603816	顾家家居	500	22,505.00	0.04
493	000970	中科三环	2,300	22,494.00	0.04
494	000400	许继电气	1,700	22,440.00	0.04
495	600373	中文传媒	1,900	22,382.00	0.04
496	002429	兆驰股份	4,500	22,275.00	0.04
497	600754	锦江酒店	800	22,200.00	0.04
498	600273	嘉化能源	2,500	21,850.00	0.04
499	603568	伟明环保	940	21,808.00	0.04
500	300133	华策影视	3,000	21,750.00	0.04
501	002233	塔牌集团	1,800	21,654.00	0.04
502	600282	南钢股份	6,700	21,641.00	0.04
503	601005	重庆钢铁	14,500	21,605.00	0.04
504	600633	浙数文化	2,200	21,516.00	0.04
505	000709	河钢股份	10,500	21,420.00	0.04
506	000960	锡业股份	2,500	21,400.00	0.04
507	002191	劲嘉股份	2,400	21,384.00	0.04
508	601216	君正集团	8,400	21,336.00	0.04
509	000629	攀钢钒钛	10,600	21,306.00	0.04
510	601916	浙商银行	5,400	21,276.00	0.04
511	002807	江阴银行	5,400	21,222.00	0.04
512	000598	兴蓉环境	4,600	21,160.00	0.04
513	002648	卫星石化	1,300	21,151.00	0.04
514	600392	盛和资源	3,000	21,150.00	0.04
515	603486	科沃斯	700	21,147.00	0.04
516	600755	厦门国贸	3,200	21,120.00	0.04
517	600195	中牧股份	1,300	21,099.00	0.04
518	600188	兖州煤业	2,400	21,024.00	0.04
519	600039	四川路桥	5,500	21,010.00	0.04
520	002203	海亮股份	2,400	21,000.00	0.04
521	002183	怡亚通	3,900	20,904.00	0.04
522	000563	陕国投 A	5,600	20,776.00	0.04
523	002085	万丰奥威	3,200	20,736.00	0.04
524	601238	广汽集团	2,300	20,700.00	0.04
525	601975	招商南油	8,600	20,554.00	0.04
526	600166	福田汽车	11,400	20,520.00	0.04
527	600466	蓝光发展	3,800	20,482.00	0.04
528	000738	航发控制	1,500	20,475.00	0.04
529	601118	海南橡胶	4,200	20,412.00	0.04
530	600566	济川药业	800	20,368.00	0.04
531	300182	捷成股份	5,100	20,349.00	0.04
532	000690	宝新能源	4,300	20,296.00	0.04
533	000778	新兴铸管	5,900	20,237.00	0.04
534	600737	中粮糖业	2,600	20,228.00	0.04
535	601098	中南传媒	1,900	20,102.00	0.04

536	002745	木林森	1,300	20,033.00	0.04
537	002110	三钢闽光	3,000	19,980.00	0.04
537	300324	旋极信息	3,000	19,980.00	0.04
538	000402	金融街	3,000	19,920.00	0.04
538	002635	安洁科技	800	19,920.00	0.04
539	601577	长沙银行	2,500	19,850.00	0.04
540	600056	中国医药	1,400	19,810.00	0.04
541	601808	中海油服	1,500	19,710.00	0.04
542	300180	华峰超纤	2,300	19,688.00	0.04
543	600435	北方导航	2,600	19,656.00	0.04
544	002506	协鑫集成	7,500	19,575.00	0.04
545	002595	豪迈科技	1,000	19,460.00	0.04
546	601236	红塔证券	1,000	19,400.00	0.04
547	600388	龙净环保	2,200	19,360.00	0.04
548	600515	海航基础	3,700	19,240.00	0.04
549	002038	双鹭药业	1,500	19,215.00	0.04
550	600398	海澜之家	3,300	19,206.00	0.04
551	000089	深圳机场	2,500	19,150.00	0.04
552	000983	西山煤电	5,100	19,125.00	0.04
553	000930	中粮科技	2,800	19,124.00	0.04
554	601106	中国一重	6,800	19,108.00	0.04
555	600808	马钢股份	7,400	19,092.00	0.04
556	600643	爱建集团	2,400	19,080.00	0.04
557	601860	紫金银行	4,500	19,035.00	0.04
558	002092	中泰化学	4,200	19,026.00	0.04
559	002839	张家港行	3,300	19,008.00	0.04
560	000967	盈峰环境	2,300	18,975.00	0.04
560	002583	海能达	2,500	18,975.00	0.04
561	600120	浙江东方	2,760	18,961.20	0.04
562	601333	广深铁路	8,400	18,900.00	0.04
563	000039	中集集团	2,600	18,798.00	0.04
564	000723	美锦能源	3,000	18,780.00	0.04
565	600376	首开股份	3,200	18,752.00	0.04
566	600729	重庆百货	600	18,732.00	0.04
567	000830	鲁西化工	2,500	18,650.00	0.04
568	000681	视觉中国	1,000	18,620.00	0.04
569	002372	伟星新材	1,600	18,608.00	0.04
570	000825	太钢不锈	5,600	18,592.00	0.04
571	002048	宁波华翔	1,200	18,528.00	0.04
572	600989	宝丰能源	2,200	18,524.00	0.04
573	000685	中山公用	2,400	18,480.00	0.04
574	600258	首旅酒店	1,200	18,444.00	0.04
575	600649	城投控股	3,100	18,414.00	0.04
576	600675	中华企业	4,500	18,315.00	0.04

577	002064	华峰氨纶	3,600	18,252.00	0.04
578	002815	崇达技术	900	18,207.00	0.04
579	600025	华能水电	4,800	18,192.00	0.04
580	000415	渤海租赁	6,100	18,178.00	0.04
581	002155	湖南黄金	2,300	18,124.00	0.04
582	600776	东方通信	1,200	18,108.00	0.04
583	002407	多氟多	1,700	18,088.00	0.04
584	000012	南玻 A	3,600	18,072.00	0.04
585	601866	中远海发	9,800	18,032.00	0.04
586	601698	中国卫通	1,000	18,010.00	0.03
587	000028	国药一致	400	18,004.00	0.03
588	601718	际华集团	5,400	17,928.00	0.03
589	600266	城建发展	3,520	17,846.40	0.03
590	601615	明阳智能	1,400	17,430.00	0.03
591	600022	山东钢铁	13,500	17,415.00	0.03
592	002010	传化智联	3,200	17,408.00	0.03
593	600316	洪都航空	1,100	17,380.00	0.03
594	002375	亚厦股份	1,700	17,374.00	0.03
595	600928	西安银行	3,300	17,358.00	0.03
596	600372	中航电子	1,300	17,316.00	0.03
597	000027	深圳能源	3,727	17,293.28	0.03
598	603077	和邦生物	13,100	17,292.00	0.03
599	601699	潞安环能	3,100	17,267.00	0.03
600	000501	鄂武商 A	1,100	17,248.00	0.03
600	000883	湖北能源	4,900	17,248.00	0.03
601	600500	中化国际	3,400	17,204.00	0.03
602	600062	华润双鹤	1,300	17,186.00	0.03
603	000078	海王生物	4,100	17,179.00	0.03
604	601898	中煤能源	4,500	17,100.00	0.03
605	002936	郑州银行	4,950	17,028.00	0.03
606	000807	云铝股份	3,900	17,004.00	0.03
607	000932	华菱钢铁	4,500	16,965.00	0.03
608	000519	中兵红箭	1,800	16,956.00	0.03
609	000559	万向钱潮	3,500	16,940.00	0.03
610	002640	跨境通	2,600	16,874.00	0.03
611	000488	晨鸣纸业	3,400	16,796.00	0.03
612	000959	首钢股份	3,900	16,770.00	0.03
613	000301	东方盛虹	3,000	16,680.00	0.03
614	002440	闰土股份	1,800	16,452.00	0.03
615	000528	柳工	2,600	16,406.00	0.03
616	000987	越秀金控	1,400	16,324.00	0.03
616	600312	平高电气	2,200	16,324.00	0.03
617	000031	大悦城	3,200	16,288.00	0.03
618	601000	唐山港	7,300	16,279.00	0.03

619	002244	滨江集团	3,800	16,226.00	0.03
620	600640	号百控股	800	15,960.00	0.03
621	002625	光启技术	2,200	15,950.00	0.03
622	002701	奥瑞金	3,800	15,922.00	0.03
623	600782	新钢股份	3,900	15,912.00	0.03
624	600908	无锡银行	3,200	15,712.00	0.03
625	002266	浙富控股	4,000	15,480.00	0.03
626	002444	巨星科技	1,300	15,444.00	0.03
627	000708	中信特钢	900	15,381.00	0.03
628	600777	新潮能源	10,100	15,352.00	0.03
629	601717	郑煤机	2,600	15,314.00	0.03
630	603198	迎驾贡酒	700	15,239.00	0.03
631	000898	鞍钢股份	6,200	15,190.00	0.03
632	600073	上海梅林	1,600	15,184.00	0.03
633	300459	金科文化	4,400	15,180.00	0.03
634	000156	华数传媒	1,400	15,162.00	0.03
635	600125	铁龙物流	2,700	15,066.00	0.03
636	002390	信邦制药	3,300	15,048.00	0.03
637	600259	广晟有色	500	15,000.00	0.03
638	300072	三聚环保	3,500	14,980.00	0.03
639	002424	贵州百灵	1,800	14,940.00	0.03
640	000813	德展健康	2,400	14,880.00	0.03
641	601958	金钼股份	2,400	14,832.00	0.03
642	002563	森马服饰	2,100	14,805.00	0.03
643	002434	万里扬	1,700	14,756.00	0.03
644	601608	中信重工	4,300	14,706.00	0.03
645	000046	泛海控股	3,900	14,703.00	0.03
646	000758	中色股份	3,500	14,630.00	0.03
647	601880	大连港	8,500	14,620.00	0.03
648	600291	西水股份	1,600	14,480.00	0.03
649	600409	三友化工	3,100	14,446.00	0.03
650	000008	神州高铁	4,900	14,406.00	0.03
651	600765	中航重机	1,400	14,308.00	0.03
652	002505	大康农业	6,300	14,175.00	0.03
653	600717	天津港	3,200	14,144.00	0.03
654	000887	中鼎股份	1,800	14,130.00	0.03
655	600751	海航科技	4,500	14,085.00	0.03
656	002002	鸿达兴业	3,900	14,079.00	0.03
657	600863	内蒙华电	5,700	14,022.00	0.03
658	600507	方大特钢	2,700	14,013.00	0.03
659	601228	广州港	4,600	13,984.00	0.03
660	002589	瑞康医药	2,600	13,936.00	0.03
661	600557	康缘药业	1,000	13,920.00	0.03
662	600158	中体产业	1,700	13,906.00	0.03

663	600138	中青旅	1,400	13,818.00	0.03
664	000712	锦龙股份	1,100	13,750.00	0.03
665	600970	中材国际	2,600	13,728.00	0.03
666	000869	张裕 A	400	13,660.00	0.03
667	600478	科力远	2,900	13,659.00	0.03
668	603885	吉祥航空	1,500	13,650.00	0.03
669	601928	凤凰传媒	2,000	13,600.00	0.03
670	600835	上海机电	800	13,544.00	0.03
671	603888	新华网	600	13,416.00	0.03
672	002249	大洋电机	3,700	13,357.00	0.03
673	000826	启迪环境	1,800	13,356.00	0.03
674	000061	农产品	1,800	13,338.00	0.03
675	002653	海思科	500	13,305.00	0.03
676	002867	周大生	600	13,302.00	0.03
677	600545	卓郎智能	2,800	13,244.00	0.03
678	601077	渝农商行	2,800	13,216.00	0.03
679	601200	上海环境	1,100	13,200.00	0.03
680	601611	中国核建	2,100	12,978.00	0.03
681	002503	搜于特	4,600	12,926.00	0.03
682	600639	浦东金桥	800	12,784.00	0.02
683	600648	外高桥	900	12,726.00	0.02
684	000732	泰禾集团	2,500	12,725.00	0.02
685	600348	阳泉煤业	3,000	12,660.00	0.02
686	601598	中国外运	3,900	12,597.00	0.02
687	300134	大富科技	900	12,582.00	0.02
688	600823	世茂股份	2,800	12,516.00	0.02
689	600901	江苏租赁	2,400	12,504.00	0.02
690	002665	首航高科	5,100	12,444.00	0.02
691	601869	长飞光纤	400	12,324.00	0.02
692	600748	上实发展	2,400	12,264.00	0.02
693	600329	中新药业	700	12,124.00	0.02
694	600968	海油发展	5,200	12,116.00	0.02
695	600582	天地科技	4,100	12,013.00	0.02
696	600664	哈药股份	3,900	12,012.00	0.02
697	300376	易事特	2,300	11,960.00	0.02
698	600053	九鼎投资	400	11,936.00	0.02
699	002901	大博医疗	100	11,929.00	0.02
700	600307	酒钢宏兴	7,700	11,858.00	0.02
701	002544	杰赛科技	900	11,835.00	0.02
702	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
703	000718	苏宁环球	3,800	11,742.00	0.02
704	600141	兴发集团	1,300	11,635.00	0.02
704	603650	彤程新材	500	11,635.00	0.02
705	000062	深圳华强	800	11,632.00	0.02

706	603377	东方时尚	700	11,592.00	0.02
707	002302	西部建设	1,200	11,520.00	0.02
708	002419	天虹股份	1,200	11,460.00	0.02
709	600017	日照港	4,600	11,454.00	0.02
710	601678	滨化股份	2,700	11,448.00	0.02
711	000990	诚志股份	900	11,421.00	0.02
712	000717	韶钢松山	3,000	11,400.00	0.02
713	000543	皖能电力	2,800	11,256.00	0.02
714	000848	承德露露	1,600	11,200.00	0.02
714	600869	智慧能源	2,800	11,200.00	0.02
715	002408	齐翔腾达	1,800	11,178.00	0.02
716	603317	天味食品	200	11,116.00	0.02
717	600277	亿利洁能	3,400	11,084.00	0.02
718	603515	欧普照明	400	10,948.00	0.02
719	603260	合盛硅业	400	10,936.00	0.02
720	002128	露天煤业	1,400	10,850.00	0.02
721	002416	爱施德	1,500	10,770.00	0.02
722	002948	青岛银行	2,100	10,689.00	0.02
723	002093	国脉科技	1,200	10,620.00	0.02
724	600565	迪马股份	3,800	10,602.00	0.02
725	601828	美凯龙	1,000	10,590.00	0.02
726	300257	开山股份	800	10,456.00	0.02
727	603328	依顿电子	1,000	10,430.00	0.02
728	300197	铁汉生态	4,100	10,414.00	0.02
729	601139	深圳燃气	1,600	10,400.00	0.02
730	002491	通鼎互联	2,000	10,240.00	0.02
731	000537	广宇发展	1,400	10,220.00	0.02
732	600787	中储股份	2,300	10,097.00	0.02
733	000553	安道麦 A	1,100	9,922.00	0.02
734	603766	隆鑫通用	2,500	9,675.00	0.02
735	000600	建投能源	1,900	9,671.00	0.02
736	002945	华林证券	700	9,667.00	0.02
737	601298	青岛港	1,700	9,656.00	0.02
738	600770	综艺股份	2,000	9,600.00	0.02
739	600694	大商股份	400	9,596.00	0.02
740	600657	信达地产	2,300	9,476.00	0.02
741	603056	德邦股份	700	9,471.00	0.02
742	601212	白银有色	3,700	9,435.00	0.02
743	601865	福莱特	500	9,400.00	0.02
744	601019	山东出版	1,500	9,375.00	0.02
745	600339	中油工程	4,100	9,307.00	0.02
746	600350	山东高速	1,500	9,210.00	0.02
747	600338	西藏珠峰	900	9,000.00	0.02
748	002118	紫鑫药业	2,000	8,880.00	0.02

749	002470	*ST 金正	3,900	8,853.00	0.02
750	002051	中工国际	1,200	8,736.00	0.02
751	601016	节能风电	4,100	8,692.00	0.02
752	600707	彩虹股份	1,900	8,664.00	0.02
752	603556	海兴电力	600	8,664.00	0.02
753	603983	丸美股份	100	8,603.00	0.02
754	600985	淮北矿业	1,100	8,569.00	0.02
755	600299	安迪苏	700	8,554.00	0.02
756	002941	新疆交建	600	8,490.00	0.02
757	600006	东风汽车	2,100	8,463.00	0.02
758	002285	世联行	3,000	8,370.00	0.02
759	601801	皖新传媒	1,500	8,340.00	0.02
760	600428	中远海特	2,700	8,316.00	0.02
761	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.02
762	600575	淮河能源	3,800	7,942.00	0.02
763	000937	冀中能源	2,600	7,852.00	0.02
764	600757	长江传媒	1,500	7,635.00	0.01
765	603786	科博达	100	7,535.00	0.01
766	601969	海南矿业	1,500	7,320.00	0.01
767	600874	创业环保	1,100	7,304.00	0.01
768	600623	华谊集团	1,400	7,224.00	0.01
769	600996	贵广网络	1,000	7,130.00	0.01
770	002946	新乳业	400	6,940.00	0.01
771	600903	贵州燃气	700	6,888.00	0.01
772	600058	五矿发展	1,100	6,644.00	0.01
773	601003	柳钢股份	1,300	5,759.00	0.01
774	601512	中新集团	500	5,750.00	0.01
775	603379	三美股份	260	5,582.20	0.01
776	000785	居然之家	700	5,544.00	0.01
777	000025	特力 A	300	5,499.00	0.01
778	601811	新华文轩	500	5,085.00	0.01
779	600335	国机汽车	1,100	5,082.00	0.01
780	603225	新凤鸣	500	4,990.00	0.01
781	601127	小康股份	600	4,986.00	0.01
782	603355	莱克电气	200	4,978.00	0.01
783	603868	飞科电器	100	4,933.00	0.01
784	002818	富森美	400	4,920.00	0.01
785	001872	招商港口	300	4,365.00	0.01
786	002423	中粮资本	500	4,350.00	0.01
787	603025	大豪科技	500	3,635.00	0.01
788	600917	重庆燃气	500	3,570.00	0.01
789	603256	宏和科技	300	3,432.00	0.01
790	601068	中铝国际	800	3,128.00	0.01
791	002957	科瑞技术	100	2,390.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	14,362,721.66	27.90
2	600519	贵州茅台	11,103,338.56	21.57
3	600036	招商银行	5,098,988.00	9.90
4	600276	恒瑞医药	4,180,465.02	8.12
5	000651	格力电器	3,505,184.00	6.81
6	000333	美的集团	3,490,054.00	6.78
7	000858	五粮液	3,417,468.00	6.64
8	601166	兴业银行	3,340,101.00	6.49
9	600030	中信证券	2,879,018.00	5.59
10	600887	伊利股份	2,490,614.00	4.84
11	600900	长江电力	2,223,005.00	4.32
12	600016	民生银行	2,060,953.00	4.00
13	601328	交通银行	2,012,864.00	3.91
14	002475	立讯精密	1,897,733.00	3.69
15	601288	农业银行	1,859,656.00	3.61
16	000002	万科 A	1,835,288.00	3.56
17	603288	海天味业	1,816,094.98	3.53
18	601398	工商银行	1,808,701.00	3.51
19	600000	浦发银行	1,758,682.29	3.42
20	600031	三一重工	1,706,321.00	3.31
21	600585	海螺水泥	1,689,378.40	3.28
22	600048	保利地产	1,593,973.00	3.10
23	601668	中国建筑	1,550,314.00	3.01
24	601888	中国中免	1,518,605.90	2.95
25	000001	平安银行	1,486,494.00	2.89
26	600837	海通证券	1,486,072.00	2.89
27	002415	海康威视	1,452,837.00	2.82
28	300498	温氏股份	1,340,715.00	2.60
29	601601	中国太保	1,288,919.00	2.50
30	000063	中兴通讯	1,271,469.00	2.47
31	300059	东方财富	1,233,087.28	2.40
32	000725	京东方 A	1,225,785.00	2.38
33	000661	长春高新	1,198,271.00	2.33
34	002714	牧原股份	1,187,388.00	2.31
35	601688	华泰证券	1,187,304.00	2.31

36	600309	万华化学	1,178,858.00	2.29
37	600009	上海机场	1,126,924.00	2.19
38	601012	隆基股份	1,092,422.00	2.12
39	601211	国泰君安	1,087,320.00	2.11
40	603259	药明康德	1,075,531.50	2.09
41	601169	北京银行	1,046,263.00	2.03
42	601988	中国银行	1,041,803.00	2.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	12,490,884.63	24.26
2	600519	贵州茅台	9,712,274.09	18.86
3	600036	招商银行	4,224,432.00	8.21
4	600276	恒瑞医药	3,484,661.00	6.77
5	601166	兴业银行	2,831,377.00	5.50
6	600030	中信证券	2,350,586.91	4.57
7	600887	伊利股份	2,035,273.00	3.95
8	600900	长江电力	1,873,242.23	3.64
9	600016	民生银行	1,746,317.00	3.39
10	601328	交通银行	1,664,398.00	3.23
11	601288	农业银行	1,610,683.00	3.13
12	603288	海天味业	1,587,495.70	3.08
13	600000	浦发银行	1,468,945.00	2.85
14	600031	三一重工	1,366,495.09	2.65
15	601888	中国中免	1,363,672.00	2.65
16	601398	工商银行	1,345,190.00	2.61
17	600585	海螺水泥	1,305,089.00	2.53
18	600048	保利地产	1,292,433.00	2.51
19	601668	中国建筑	1,271,609.00	2.47
20	600837	海通证券	1,202,360.00	2.34
21	601601	中国太保	1,047,988.00	2.04

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	256,634,574.87
卖出股票收入（成交）总额	145,406,478.56

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年

内未受到公开谴责、处罚。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	72,150.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,176.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	78,706.96
8	其他	-
9	合计	152,034.02

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,363	35,601.34	6,825,502.00	14.07%	41,699,118.00	85.93%

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	广发证券股份有限公司	3,354,735.00	6.91%
2	罗丹	1,830,800.00	3.77%
3	方正证券股份有限公司	1,370,818.00	2.82%
4	王颖智	1,313,736.00	2.71%
5	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	1,099,708.00	2.27%
6	北京开诚工程技术有限责 任公司	1,000,145.00	2.06%
7	唐晓华	990,000.00	2.04%
8	卓汉彬	883,621.00	1.82%
9	朱广祥	787,076.00	1.62%
10	余荣华	600,063.00	1.24%

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（2020 年 4 月 13 日）基金份额总额	222,524,620.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	33,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	207,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	48,524,620.00

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2020 年 4 月 13 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

安信证券	5	4,524,733.00	1.13%	3,308.93	0.96%	新增 5 个
广发证券	7	69,688,121.08	17.33%	64,880.99	18.79%	新增 7 个
西藏东方财富 证券	2	140,600,355.41	34.97%	102,824.47	29.77%	新增 2 个
东北证券	4	187,201,596.30	46.57%	174,341.93	50.48%	新增 4 个
浙商证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中金财富证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
川财证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
天风证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
世纪证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国元证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
长江证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
东兴证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
申万宏源	6	-	-	-	-	新增 6 个
联讯证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
招商证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
华安证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信建投	5	-	-	-	-	新增 5 个
华融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华林证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东方证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
平安证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
华菁证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
光大证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
中银国际	2	-	-	-	-	新增 2 个
方正证券	5	-	-	-	-	新增 5 个
中金公司	4	-	-	-	-	新增 4 个
中信证券	5	-	-	-	-	新增 5 个
国信证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
渤海证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华福证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
信达证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
西部证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
南京证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华宝证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中山证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
海通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
长城证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
瑞银证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
北京高华	1	-	-	-	-	新增 1 个
东吴证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
第一创业证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

东海证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
万联证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
华创证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
广州证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
西南证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华鑫证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国金证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国都证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
英大证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
德邦证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
新时代证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
兴业证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
首创证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华泰证券	5	-	-	-	-	新增 5 个
民生证券	3	-	-	-	-	新增 3 个
国海证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
银河证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
国盛证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
财富证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国泰君安	3	-	-	-	-	新增 3 个
上海证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
万和证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东莞证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中天证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中泰证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
湘财证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

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

10.7.2 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	8,200.00	41.91%	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	11,366.43	58.09%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加中信证券（华南）为广发中证 800 交易型开放式指数证券投资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	2020-05-29
2	关于广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-19
3	关于广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-15
4	广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-15
5	关于旗下被动型指数基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-12
6	广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-12
7	广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-12
8	关于广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-12
9	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-24
10	关于广发中证 800 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的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
11	关于广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-14
12	关于广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金延长募集期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-27
13	关于广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上网发售的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-23
14	关于增加华安证券为广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金网下现金发售代理机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-19
15	广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-19

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

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》及本基金基金合同的

有关规定，本基金管理人决定调整该基金标的指数许可使用费，并相应修订该基金的招募说明书。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证 800 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 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- （二）《广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《广发中证 800 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