

广发中证全指信息技术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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
8 基金份额持有人信息	68

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2	期末上市基金前十名持有人	68
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	70
9	开放式基金份额变动	70
10	重大事件揭示	70
10.1	基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4	基金投资策略的改变	70
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8	其他重大事件	72
11	影响投资者决策的其他重要信息	73
12	备查文件目录	74
12.1	备查文件目录	74
12.2	存放地点	74
12.3	查阅方式	75

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指信息技术 ETF
场内简称	信息技术
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 8 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	1,278,828,053.00 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	2015 年 2 月 5 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	中证全指信息技术指数。
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	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1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	199,312,635.25
本期利润	321,383,234.81
加权平均基金份额本期利润	0.2155
本期加权平均净值利润率	16.91%
本期基金份额净值增长率	22.22%
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	-68,294,920.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0534
期末基金资产净值	1,804,821,370.02
期末基金份额净值	1.4113
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	41.13%

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）。

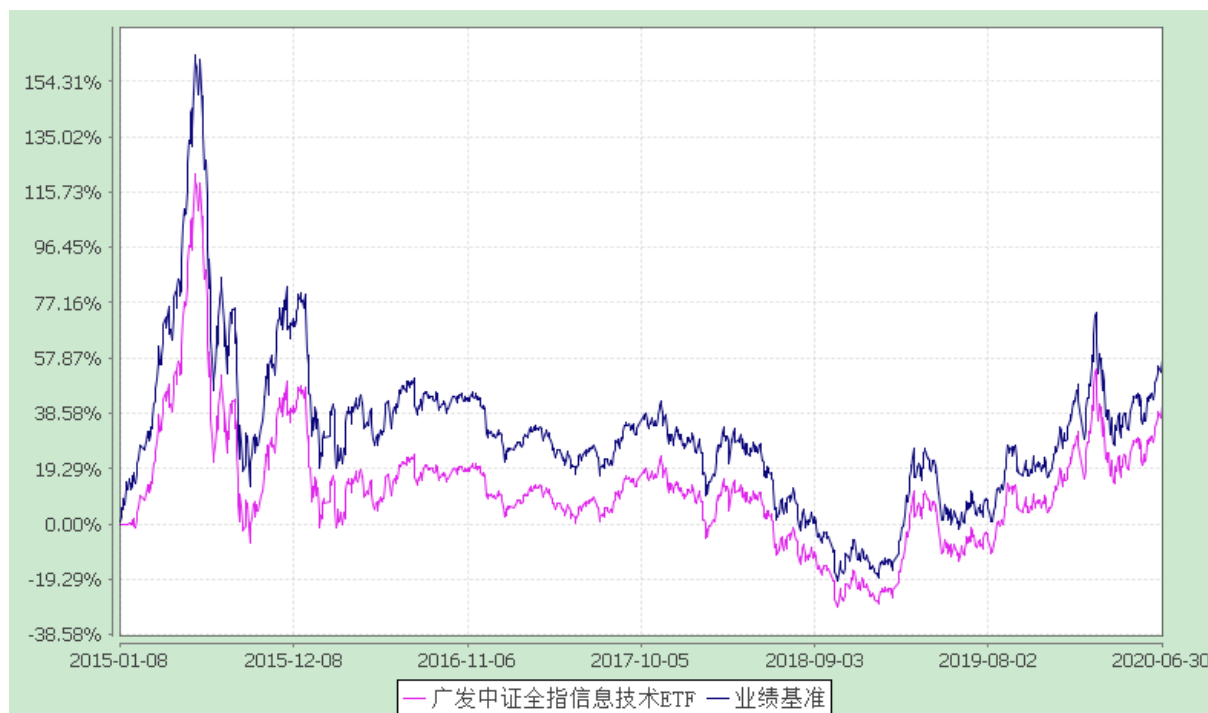
3.2 基金净值表现

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	15.80%	1.40%	15.58%	1.41%	0.22%	-0.01%
过去三个月	23.87%	1.83%	23.42%	1.85%	0.45%	-0.02%
过去六个月	22.22%	2.48%	21.45%	2.52%	0.77%	-0.04%
过去一年	50.09%	2.10%	48.40%	2.13%	1.69%	-0.03%
过去三年	30.39%	1.94%	24.43%	1.97%	5.96%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.13%	2.16%	57.13%	2.20%	-16.00%	-0.04%

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

广发中证全指信息技术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
 （2015 年 1 月 8 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		
霍华明	本基金的基金经理；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；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证建设工程指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证京津冀协同发展主题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	2017-04-20	-	12 年	霍华明先生，理学硕士，持有中国证券基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析员、ETF 基金助理兼研究员。

	<p>小板 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；</p> <p>广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；</p> <p>广发中证环保产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；</p> <p>广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；</p> <p>广发中证军工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；</p> <p>广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金的基金经理</p>				
陆志明	<p>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；</p> <p>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</p>	2015-01-08	-	21 年	<p>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</p>

	<p>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的基金经理；广发中证</p>				<p>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>
--	---	--	--	--	---

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

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投资策略跟踪指数，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。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%，中证全指信息技术指数上涨 21.45%。1 月-5 月，计算机、通信和其他电子设备制造业的工业增加值同比增速为 3.7%，而整体的工业增加值增速为-2.8%，可见信息技术行业的表现是好于整体经济的。

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 22.22%，同期业绩比较基准收益率为 21.45%。

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。5G 商用可以有效带动信息技术产业链快速发展，主要体现在以下几个方面：一是大量网络设备采购，二是手机终端升级换代，三是推动开发出更多应用程序。从间接贡献看，5G 与云计算、大数据、人工智能等技术深度融合，将支撑传统产业研发设计、生产制造、管理服务等生产流程的全面深刻变革，为传统产业优化结构、提质增效助一臂之力。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指信息技术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：广发中证全指信息技术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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	8,151,725.57	24,835,040.49
结算备付金		630,095.70	431,870.96
存出保证金		52,901.68	77,654.55
交易性金融资产	6.4.7.2	1,797,947,802.98	1,412,311,618.95
其中：股票投资		1,796,528,302.98	1,411,743,818.95
基金投资		-	-
债券投资		1,419,500.00	567,800.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,379,080.91	1,041,681.33
应收利息	6.4.7.5	43,351.66	6,145.63
应收股利		27,280.03	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,808,232,238.53	1,438,704,011.91
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		588,587.75	471,717.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		750,145.44	658,149.81
应付托管费		150,029.09	131,629.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	615,748.41	339,398.91
应交税费		3,349.21	54.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,303,008.61	1,980,716.20
负债合计		3,410,868.51	3,581,666.53
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,278,828,053.00	1,242,828,053.00
未分配利润	6.4.7.10	525,993,317.02	192,294,292.38
所有者权益合计		1,804,821,370.02	1,435,122,345.38
负债和所有者权益总计		1,808,232,238.53	1,438,704,011.91

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4113 元，基金份额总额 1,278,828,053.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证全指信息技术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		329,257,855.65	51,332,536.45
1.利息收入		411,609.45	40,057.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	107,742.74	40,057.20
债券利息收入		753.84	-
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		303,112.87	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		206,834,129.60	-1,630,066.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	199,575,451.44	-7,751,509.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	376,058.30	-
资产支持证券投资		-	-

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	6,882,619.86	6,121,443.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	122,070,599.56	52,523,148.93
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	-58,482.96	399,397.00
减：二、费用		7,874,620.84	3,224,345.85
1. 管理人报酬		4,718,039.27	2,214,067.98
2. 托管费		943,607.85	442,813.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,827,562.57	331,078.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,094.34	-
7. 其他费用	6.4.7.19	384,316.81	236,386.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		321,383,234.81	48,108,190.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		321,383,234.81	48,108,190.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指信息技术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）	1,242,828,053.00	192,294,292.38	1,435,122,345.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	321,383,234.81	321,383,234.81
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）	36,000,000.00	12,315,789.83	48,315,789.83
其中：1.基金申购款	1,496,000,000.00	427,815,517.91	1,923,815,517.91
2.基金赎回款	-1,460,000,000.00	-415,499,728.08	-1,875,499,728.08
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）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,278,828,053.00	525,993,317.02	1,804,821,370.02
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）	470,828,053.00	-125,906,674.79	344,921,378.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,108,190.60	48,108,190.60
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）	908,000,000.00	-4,454,002.56	903,545,997.44
其中：1.基金申购款	1,202,000,000.00	6,087,969.89	1,208,087,969.89
2.基金赎回款	-294,000,000.00	-10,541,972.45	-304,541,972.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,378,828,053.00	-82,252,486.75	1,296,575,566.25

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

广发中证全指信息技术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[2014]1269 号《关于核准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》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《广发中证全指信息技术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 2015 年 1 月 8 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 2014 年 12 月 15 日至 2014 年 12 月 26 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 354,828,053.00 元，有效认购户数为 3,988 户。其中，认购资金在

募集期间产生的利息共计人民币 22,681.00 元，折合基金份额 22,681.00 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	8,151,725.57
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	8,151,725.57

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	1,533,739,343.85	1,796,528,302.98	262,788,959.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,419,500.00	1,419,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,419,500.00	1,419,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,535,158,843.85	1,797,947,802.98	262,788,959.13

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	871.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	21.42
应收结算备付金利息	502.88
应收债券利息	118.23
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	41,837.75
其他	-
合计	43,351.66

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	615,748.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	615,748.41

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	96,470.92
应付替代款	890,911.33

可退替代款	32,544.09
应付指数使用费	283,082.27
合计	1,303,008.61

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	1,242,828,053.00	1,242,828,053.00
本期申购	1,496,000,000.00	1,496,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,460,000,000.00	-1,460,000,000.00
本期末	1,278,828,053.00	1,278,828,053.00

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	-239,899,414.95	432,193,707.33	192,294,292.38
本期利润	199,312,635.25	122,070,599.56	321,383,234.81
本期基金份额交易产生的变动数	-27,708,140.65	40,023,930.48	12,315,789.83
其中：基金申购款	-201,993,252.32	629,808,770.23	427,815,517.91
基金赎回款	174,285,111.67	-589,784,839.75	-415,499,728.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-68,294,920.35	594,288,237.37	525,993,317.02

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	96,012.62
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	630.99	
结算备付金利息收入	11,099.13	
其他	-	
合计	107,742.74	

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	78,166,530.19
股票投资收益——赎回差价收入	121,408,921.25	

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	199,575,451.44

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	617,643,227.90
减：卖出股票成本总额	539,476,697.71
买卖股票差价收入	78,166,530.19

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	1,875,499,728.08
减：现金支付赎回款总额	465,753,810.08
减：赎回股票成本总额	1,288,336,996.75
赎回差价收入	121,408,921.25

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	376,058.30
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	376,058.30

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	1,966,879.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,590,100.00
减：应收利息总额	721.01
买卖债券差价收入	376,058.30

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	6,882,619.86
其中：证券出借权益补偿收入	144,450.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,882,619.86

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	122,063,234.15
——股票投资	122,063,234.15
——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	7,365.41
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	122,070,599.56

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

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	-58,482.96
合计	-58,482.96

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	1,827,562.57
银行间市场交易费用	-
合计	1,827,562.57

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	36,798.58
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,763.62
指数使用费	283,082.27
合计	384,316.81

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	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	176,260,464.09	12.71%	-	-

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	3,057,184.30	69.34%	-	-

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	163,531.38	15.60%	131,814.83	21.41%
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	-	-	-	-

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	4,718,039.27	2,214,067.98
其中：支付销售机构的客户维护费	48,292.76	32,116.82

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 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托管费	943,607.85	442,813.53

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	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发中证全指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	674,967,124.00	52.78%	558,062,537.00	44.90%
广发证券股份有限公司	-	-	6,583,247.00	0.53%

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	8,151,725.57	96,012.62	13,160,246.98	31,601.79

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

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
002624	完美世界	2020-02-27	2020-08-27	大宗买入流通受限	45.58	55.86	50,000.00	2,279,000.00	2,793,000.00	-
300418	昆仑万维	2020-03-04	2020-09-04	大宗买入流通受限	20.27	23.79	100,000.00	2,027,000.00	2,379,000.00	2020-06-10 除权除息, 派息比例 0.0257 (含税)
300598	诚迈科技	2020-04-02	2020-10-09	大宗买入流通受限	229.64	172.64	11,700.00	2,066,760.00	2,019,888.00	2020-06-08 除权除息, 派息比例 0.0120 (含税), 转增比例 0.3000
300324	旋极信息	2020-03-25	2020-09-25	大宗买入流通受限	6.84	6.23	300,000.00	2,052,000.00	1,869,000.00	2020-06-08 除权除息, 派息比例 0.0450 (含税)
68818	八亿	2019-1	2020-0	新股	43.98	61.09	4,306.	189,37	263,05	2020-0

1	时空	2-27	7-06	流通受限			00	7.88	3.54	6-11 除权除息,派息比例 0.3600 (含税)
688568	中科星图	2020-06-30	2021-01-08	新股流通受限	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股流通受限	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股流通受限	15.50	15.50	5,468.00	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股流通受限	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
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	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股流通受限	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	新债流通受限	100.00	100.00	14,195.00	1,419,500.00	1,419,500.00	-

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
300561	汇金科技	2020-06-29	重大事项停牌	16.17	2020-07-13	17.79	43,086.00	660,909.88	696,700.62	-
000662	*ST 天夏	2020-06-30	重大事项停牌	2.48	2020-07-01	2.36	285,262.00	1,271,157.66	707,449.76	-
002819	东方中科	2020-06-29	重大事项停牌	25.92	2020-07-08	28.46	28,600.00	769,920.73	741,312.00	-
600242	*ST 中昌	2020-06-30	重大事项停牌	6.35	2020-07-01	6.03	119,000.00	941,026.01	755,650.00	-

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

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
2020060500003270	300002	神州泰岳	2020-06-05	2020-07-03	6.19	59,800.00	370,162.00
2020060500003300	600584	长电科技	2020-06-05	2020-07-03	31.27	40,000.00	1,250,800.00
2020060800002363	000970	中科三环	2020-06-08	2020-07-06	9.78	10,000.00	97,800.00
2020060800002369	002065	东华软件	2020-06-08	2020-07-06	12.52	32,700.00	409,404.00
2020060800002371	002195	二三四五	2020-06-08	2020-07-06	2.81	16,300.00	45,803.00
202006002439	002439	启明星辰	2020-06-08	2020-07-	42.07	10,000.00	420,700.00

080000 2373				06			
202006 080000 2377	002745	木林森	2020-06-08	2020-07-06	15.41	10,000.00	154,100.00
202006 080000 2405	600460	士兰微	2020-06-08	2020-07-06	14.68	10,000.00	146,800.00
202006 080000 2415	600633	浙数文化	2020-06-08	2020-07-06	9.78	10,000.00	97,800.00
202006 080000 2429	601231	环旭电子	2020-06-08	2020-07-06	21.84	10,000.00	218,400.00
202006 080000 2933	300297	蓝盾股份	2020-06-08	2020-07-06	4.01	10,000.00	40,100.00
202006 080000 2935	300168	万达信息	2020-06-08	2020-07-06	22.07	10,000.00	220,700.00
202006 080000 2937	300418	昆仑万维	2020-06-08	2020-07-06	24.96	10,000.00	249,600.00
202006 080000 3147	000021	深科技	2020-06-08	2020-07-06	21.83	13,000.00	283,790.00
202006 080000 3155	002600	领益智造	2020-06-08	2020-07-06	10.63	10,000.00	106,300.00
202006 080000 3161	600410	华胜天成	2020-06-08	2020-07-06	13.60	19,000.00	258,400.00
202006 080000 3169	603559	中通国脉	2020-06-08	2020-07-06	22.32	10,000.00	223,200.00
202006 090000 0332	002017	东信和平	2020-06-09	2020-07-07	11.92	10,000.00	119,200.00
202006 090000 0334	002079	苏州固锝	2020-06-09	2020-07-07	13.17	10,000.00	131,700.00
202006 090000 0344	002174	游族网络	2020-06-09	2020-07-07	26.08	10,000.00	260,800.00

202006 090000 0350	002195	二三四五	2020-06-09	2020-07- 07	2.81	30,000.00	84,300.00
202006 090000 0360	002308	威创股份	2020-06-09	2020-07- 07	6.79	10,000.00	67,900.00
202006 090000 0375	002421	达实智能	2020-06-09	2020-07- 07	3.88	20,000.00	77,600.00
202006 090000 0388	002464	众应互联	2020-06-09	2020-07- 07	5.74	34,900.00	200,326.00
202006 090000 0391	002600	领益智造	2020-06-09	2020-07- 07	10.63	70,000.00	744,100.00
202006 090000 0410	002916	深南电路	2020-06-09	2020-07- 07	167.52	10,000.00	1,675,200.0 0
202006 090000 0463	300287	飞利信	2020-06-09	2020-07- 07	4.15	20,000.00	83,000.00
202006 090000 0485	300433	蓝思科技	2020-06-09	2020-07- 07	28.04	10,000.00	280,400.00
202006 090000 0535	600728	佳都科技	2020-06-09	2020-07- 07	9.11	10,000.00	91,100.00
202006 090000 0588	600330	天通股份	2020-06-09	2020-07- 07	9.97	10,000.00	99,700.00
202006 090000 0632	600703	三安光电	2020-06-09	2020-07- 07	25.00	10,000.00	250,000.00
202006 090000 0643	603890	春秋电子	2020-06-09	2020-07- 07	17.97	18,700.00	336,039.00
202006 090000 0691	600667	太极实业	2020-06-09	2020-07- 07	11.82	10,000.00	118,200.00
202006 090000 1341	600584	长电科技	2020-06-09	2020-07- 07	31.27	10,000.00	312,700.00
202006 090000	603000	人民网	2020-06-09	2020-07- 07	19.83	10,000.00	198,300.00

4303							
202006 090000 4395	002156	通富微电	2020-06-09	2020-07-07	25.05	30,000.00	751,500.00
202006 090000 5099	002104	恒宝股份	2020-06-09	2020-07-07	8.51	50,000.00	425,500.00
202006 110000 2392	300299	富春股份	2020-06-11	2020-07-09	9.05	60,000.00	543,000.00
202006 110000 2394	000021	深科技	2020-06-11	2020-07-09	21.83	10,000.00	218,300.00
202006 110000 2406	002156	通富微电	2020-06-11	2020-07-09	25.05	10,000.00	250,500.00
202006 110000 2408	002093	国脉科技	2020-06-11	2020-07-09	8.85	10,000.00	88,500.00
202006 110000 2416	600410	华胜天成	2020-06-11	2020-07-09	13.60	10,300.00	140,080.00
202006 110000 2422	603000	人民网	2020-06-11	2020-07-09	19.83	30,000.00	594,900.00
202006 150000 3634	600751	海航科技	2020-06-15	2020-07-13	3.13	36,800.00	115,184.00
202006 150000 3642	600728	佳都科技	2020-06-15	2020-07-13	9.11	26,100.00	237,771.00
202006 150000 3644	600718	东软集团	2020-06-15	2020-07-13	11.50	18,300.00	210,450.00
202006 150000 3664	600633	浙数文化	2020-06-15	2020-07-13	9.78	17,600.00	172,128.00
202006 150000 3702	600446	金证股份	2020-06-15	2020-07-13	19.40	12,500.00	242,500.00
202006 150000 3704	600460	士兰微	2020-06-15	2020-07-13	14.68	16,700.00	245,156.00
202006	600171	上海贝岭	2020-06-15	2020-07-	17.38	11,800.00	205,084.00

150000 3764				13			
202006 150000 3820	300418	昆仑万维	2020-06-15	2020-07-13	24.96	12,500.00	312,000.00
202006 150000 3822	300324	旋极信息	2020-06-15	2020-07-13	6.66	23,800.00	158,508.00
202006 150000 3826	300315	掌趣科技	2020-06-15	2020-07-13	7.33	54,700.00	400,951.00
202006 150000 3828	300296	利亚德	2020-06-15	2020-07-13	6.07	42,400.00	257,368.00
202006 150000 3848	300168	万达信息	2020-06-15	2020-07-13	22.07	16,600.00	366,362.00
202006 150000 3850	300166	东方国信	2020-06-15	2020-07-13	12.41	17,400.00	215,934.00
202006 150000 3856	300115	长盈精密	2020-06-15	2020-07-13	22.85	11,100.00	253,635.00
202006 150000 3858	300113	顺网科技	2020-06-15	2020-07-13	25.40	10,000.00	254,000.00
202006 150000 3860	300088	长信科技	2020-06-15	2020-07-13	11.20	46,900.00	525,280.00
202006 150000 3872	300002	神州泰岳	2020-06-15	2020-07-13	6.19	10,000.00	61,900.00
202006 150000 3882	002745	木林森	2020-06-15	2020-07-13	15.41	10,000.00	154,100.00
202006 150000 4852	002439	启明星辰	2020-06-15	2020-07-13	42.07	12,100.00	509,047.00
202006 150000 4870	002387	维信诺	2020-06-15	2020-07-13	14.28	15,600.00	222,768.00
202006 150000 4878	002373	千方科技	2020-06-15	2020-07-13	23.99	13,700.00	328,663.00

202006 150000 4894	002273	水晶光电	2020-06-15	2020-07- 13	17.14	25,100.00	430,214.00
202006 150000 4896	002268	卫 士 通	2020-06-15	2020-07- 13	21.34	12,100.00	258,214.00
202006 150000 4914	002217	合力泰	2020-06-15	2020-07- 13	5.25	40,000.00	210,000.00
202006 150000 4918	002195	二 三 四 五	2020-06-15	2020-07- 13	2.81	44,500.00	125,045.00
202006 150000 4924	002174	游族网络	2020-06-15	2020-07- 13	26.08	10,000.00	260,800.00
202006 150000 4968	000997	新 大 陆	2020-06-15	2020-07- 13	15.98	14,700.00	234,906.00
202006 150000 4972	000988	华工科技	2020-06-15	2020-07- 13	24.43	16,100.00	393,323.00
202006 150000 4980	000970	中科三环	2020-06-15	2020-07- 13	9.78	18,400.00	179,952.00
202006 150000 5038	000636	风华高科	2020-06-15	2020-07- 13	29.19	12,200.00	356,118.00
202006 150000 5084	000050	深天马 A	2020-06-15	2020-07- 13	15.36	20,600.00	316,416.00
202006 150000 5108	603328	依顿电子	2020-06-15	2020-07- 13	10.43	10,000.00	104,300.00
202006 160000 0311	000158	常山北明	2020-06-16	2020-07- 14	10.44	13,500.00	140,940.00
202006 160000 0729	000988	华工科技	2020-06-16	2020-07- 14	24.43	10,000.00	244,300.00
202006 160000 1025	600855	航天长峰	2020-06-16	2020-07- 14	15.90	10,000.00	159,000.00
202006 160000	002055	得润电子	2020-06-16	2020-07- 14	15.06	10,000.00	150,600.00

1311							
202006 160000 1314	600446	金证股份	2020-06-16	2020-07-14	19.40	10,000.00	194,000.00
202006 160000 1653	002174	游族网络	2020-06-16	2020-07-14	26.08	10,000.00	260,800.00
202006 160000 1767	600330	天通股份	2020-06-16	2020-07-14	9.97	10,200.00	101,694.00
202006 160000 1883	603228	景旺电子	2020-06-16	2020-07-14	35.19	10,000.00	351,900.00
202006 160000 2593	600640	号百控股	2020-06-16	2020-07-14	19.95	10,000.00	199,500.00
202006 160000 2999	002635	安洁科技	2020-06-16	2020-07-14	24.90	10,000.00	249,000.00
202006 160000 3132	300010	立思辰	2020-06-16	2020-07-14	19.57	10,000.00	195,700.00
202006 160000 3209	300066	三川智慧	2020-06-16	2020-07-14	4.92	10,000.00	49,200.00
202006 160000 3223	300078	思创医惠	2020-06-16	2020-07-14	13.53	10,000.00	135,300.00
202006 160000 3225	300088	长信科技	2020-06-16	2020-07-14	11.20	29,600.00	331,520.00
202006 160000 3236	300113	顺网科技	2020-06-16	2020-07-14	25.40	10,000.00	254,000.00
202006 160000 3285	300168	万达信息	2020-06-16	2020-07-14	22.07	10,000.00	220,700.00
202006 160000 3313	300212	易华录	2020-06-16	2020-07-14	56.00	10,000.00	560,000.00
202006 160000 3315	300232	洲明科技	2020-06-16	2020-07-14	8.09	10,000.00	80,900.00
202006	300315	掌趣科技	2020-06-16	2020-07-	7.33	33,300.00	244,089.00

160000 3371				14			
202006 160000 3429	300496	中科创达	2020-06-16	2020-07-14	77.70	10,000.00	777,000.00
202006 160000 3466	300666	江丰电子	2020-06-16	2020-07-14	59.68	10,000.00	596,800.00
202006 160000 8080	300002	神州泰岳	2020-06-16	2020-07-14	6.19	20,000.00	123,800.00
202006 160000 8084	300223	北京君正	2020-06-16	2020-07-14	100.94	10,000.00	1,009,400.00
202006 160000 8086	300310	宜通世纪	2020-06-16	2020-07-14	5.60	10,000.00	56,000.00
202006 160000 8088	300346	南大光电	2020-06-16	2020-07-14	43.12	30,000.00	1,293,600.00
202006 160000 8096	000851	高鸿股份	2020-06-16	2020-07-14	8.27	90,000.00	744,300.00
202006 160000 8098	002104	恒宝股份	2020-06-16	2020-07-14	8.51	10,000.00	85,100.00
202006 160000 8102	300202	聚龙股份	2020-06-16	2020-07-14	10.75	30,000.00	322,500.00
202006 160000 8104	000066	中国长城	2020-06-16	2020-07-14	13.20	50,000.00	660,000.00
202006 160000 8128	603005	晶方科技	2020-06-16	2020-07-14	78.66	10,000.00	786,600.00
202006 160000 8132	002185	华天科技	2020-06-16	2020-07-14	13.53	20,000.00	270,600.00
202006 160000 8138	600360	华微电子	2020-06-16	2020-07-14	8.64	30,000.00	259,200.00
202006 160000 8142	600584	长电科技	2020-06-16	2020-07-14	31.27	20,000.00	625,400.00

202006 170000 0574	000158	常山北明	2020-06-17	2020-07- 15	10.44	10,000.00	104,400.00
202006 170000 5530	300010	立思辰	2020-06-17	2020-07- 15	19.57	12,800.00	250,496.00
202006 170001 2427	002185	华天科技	2020-06-17	2020-07- 15	13.53	100,000.00	1,353,000.0 0
202006 170001 2431	300310	宜通世纪	2020-06-17	2020-07- 15	5.60	30,000.00	168,000.00
202006 170001 2435	300085	银之杰	2020-06-17	2020-07- 15	16.02	30,000.00	480,600.00
202006 170001 2437	300311	任子行	2020-06-17	2020-07- 15	7.05	20,000.00	141,000.00
202006 170001 2447	600667	太极实业	2020-06-17	2020-07- 15	11.82	30,000.00	354,600.00
202006 170001 2449	002436	兴森科技	2020-06-17	2020-07- 15	12.83	35,000.00	449,050.00
202006 170001 2451	600360	华微电子	2020-06-17	2020-07- 15	8.64	30,000.00	259,200.00
202006 170001 2453	002261	拓维信息	2020-06-17	2020-07- 15	8.16	20,000.00	163,200.00
202006 170001 2459	300002	神州泰岳	2020-06-17	2020-07- 15	6.19	130,000.00	804,700.00
202006 170001 2465	603000	人民网	2020-06-17	2020-07- 15	19.83	12,000.00	237,960.00
202006 180000 0142	000158	常山北明	2020-06-18	2020-07- 16	10.44	20,300.00	211,932.00
202006 180000 0289	002174	游族网络	2020-06-18	2020-07- 16	26.08	11,300.00	294,704.00
202006 180000	300324	旋极信息	2020-06-18	2020-07- 16	6.66	22,200.00	147,852.00

0521							
202006 180000 0659	600171	上海贝岭	2020-06-18	2020-07- 16	17.38	11,900.00	206,822.00
202006 180000 0830	600460	士兰微	2020-06-18	2020-07- 16	14.68	16,700.00	245,156.00
202006 180000 0990	603501	韦尔股份	2020-06-18	2020-07- 16	201.95	10,000.00	2,019,500.0 0
202006 180000 2130	300311	任子行	2020-06-18	2020-07- 16	7.05	10,000.00	70,500.00
202006 180000 2134	002436	兴森科技	2020-06-18	2020-07- 16	12.83	15,900.00	203,997.00
202006 180000 2136	002185	华天科技	2020-06-18	2020-07- 16	13.53	33,600.00	454,608.00
202006 180000 2138	300310	宜通世纪	2020-06-18	2020-07- 16	5.60	10,000.00	56,000.00
202006 180000 2140	300379	东方通	2020-06-18	2020-07- 16	43.03	10,000.00	430,300.00
202006 180000 2144	300373	扬杰科技	2020-06-18	2020-07- 16	33.52	10,000.00	335,200.00
202006 180000 2146	300202	聚龙股份	2020-06-18	2020-07- 16	10.75	10,000.00	107,500.00
202006 180000 3116	300223	北京君正	2020-06-18	2020-07- 16	100.94	10,000.00	1,009,400.0 0
202006 180000 3120	002017	东信和平	2020-06-18	2020-07- 16	11.92	10,000.00	119,200.00
202006 180000 3122	002214	大立科技	2020-06-18	2020-07- 16	28.18	10,000.00	281,800.00
202006 180000 3124	000851	高鸿股份	2020-06-18	2020-07- 16	8.27	13,800.00	114,126.00
202006	300346	南大光电	2020-06-18	2020-07-	43.12	10,000.00	431,200.00

180000 3126				16			
202006 180000 3128	002261	拓维信息	2020-06-18	2020-07-16	8.16	10,000.00	81,600.00
202006 180000 3130	603000	人民网	2020-06-18	2020-07-16	19.83	10,000.00	198,300.00
202006 180000 3138	603005	晶方科技	2020-06-18	2020-07-16	78.66	10,000.00	786,600.00
202006 180000 3142	300085	银之杰	2020-06-18	2020-07-16	16.02	10,000.00	160,200.00
202006 180000 3146	600756	浪潮软件	2020-06-18	2020-07-16	18.50	10,000.00	185,000.00
202006 190000 0168	000021	深科技	2020-06-19	2020-07-17	21.83	20,000.00	436,600.00
202006 190000 0187	000066	中国长城	2020-06-19	2020-07-17	13.20	10,000.00	132,000.00
202006 190000 0253	002017	东信和平	2020-06-19	2020-07-17	11.92	10,000.00	119,200.00
202006 190000 0275	002095	生意宝	2020-06-19	2020-07-17	20.20	10,000.00	202,000.00
202006 190000 0277	002093	国脉科技	2020-06-19	2020-07-17	8.85	22,600.00	200,010.00
202006 190000 0279	002104	恒宝股份	2020-06-19	2020-07-17	8.51	10,000.00	85,100.00
202006 190000 0300	002156	通富微电	2020-06-19	2020-07-17	25.05	30,000.00	751,500.00
202006 190000 0302	002168	惠程科技	2020-06-19	2020-07-17	8.21	10,000.00	82,100.00
202006 190000 0303	002185	华天科技	2020-06-19	2020-07-17	13.53	50,000.00	676,500.00

202006 190000 0311	002261	拓维信息	2020-06-19	2020-07- 17	8.16	10,000.00	81,600.00
202006 190000 0313	002214	大立科技	2020-06-19	2020-07- 17	28.18	10,000.00	281,800.00
202006 190000 0332	002425	凯撒文化	2020-06-19	2020-07- 17	17.56	11,500.00	201,940.00
202006 190000 0347	002600	领益智造	2020-06-19	2020-07- 17	10.63	40,000.00	425,200.00
202006 190000 0359	002745	木林森	2020-06-19	2020-07- 17	15.41	10,000.00	154,100.00
202006 190000 0365	300020	银江股份	2020-06-19	2020-07- 17	11.40	10,000.00	114,000.00
202006 190000 0374	300038	数知科技	2020-06-19	2020-07- 17	8.16	10,000.00	81,600.00
202006 190000 0408	300310	宜通世纪	2020-06-19	2020-07- 17	5.60	10,000.00	56,000.00
202006 190000 0411	300373	扬杰科技	2020-06-19	2020-07- 17	33.52	10,000.00	335,200.00
202006 190000 0451	600584	长电科技	2020-06-19	2020-07- 17	31.27	40,000.00	1,250,800.0 0
202006 190000 0493	600360	华微电子	2020-06-19	2020-07- 17	8.64	10,000.00	86,400.00
202006 190000 0507	600410	华胜天成	2020-06-19	2020-07- 17	13.60	50,000.00	680,000.00
202006 190000 0525	600206	有研新材	2020-06-19	2020-07- 17	13.97	30,000.00	419,100.00
202006 190000 0534	600446	金证股份	2020-06-19	2020-07- 17	19.40	20,000.00	388,000.00
202006 190000	300002	神州泰岳	2020-06-19	2020-07- 17	6.19	30,000.00	185,700.00

1495							
202006 230000 1584	300567	精测电子	2020-06-23	2020-07-07	68.25	10,000.00	682,500.00
202006 230000 1650	300663	科蓝软件	2020-06-23	2020-07-07	27.71	10,000.00	277,100.00
202006 230000 1654	002425	凯撒文化	2020-06-23	2020-07-07	17.56	54,900.00	964,044.00
202006 230000 1668	002273	水晶光电	2020-06-23	2020-07-07	17.14	100,000.00	1,714,000.00
202006 230000 1796	000066	中国长城	2020-06-23	2020-07-07	13.20	96,900.00	1,279,080.00
202006 230000 1800	000636	风华高科	2020-06-23	2020-07-07	29.19	62,700.00	1,830,213.00
202006 240000 1020	600206	有研新材	2020-06-24	2020-07-22	13.97	10,000.00	139,700.00
202006 240000 1073	600446	金证股份	2020-06-24	2020-07-22	19.40	10,000.00	194,000.00
202006 240000 1255	002079	苏州固锝	2020-06-24	2020-07-22	13.17	10,000.00	131,700.00
202006 240000 1427	002152	广电运通	2020-06-24	2020-07-22	12.94	15,900.00	205,746.00
202006 240000 1632	002222	福晶科技	2020-06-24	2020-07-22	15.34	10,000.00	153,400.00
202006 240000 2160	600640	号百控股	2020-06-24	2020-07-22	19.95	10,000.00	199,500.00
202006 240000 2497	002600	领益智造	2020-06-24	2020-07-22	10.63	23,000.00	244,490.00
202006 240000 2682	300020	银江股份	2020-06-24	2020-07-22	11.40	10,000.00	114,000.00
202006	300458	全志科技	2020-06-24	2020-07-	36.80	10,000.00	368,000.00

240000 2912				22			
202006 240000 6579	002093	国脉科技	2020-06-24	2020-07- 22	8.85	25,800.00	228,330.00
202006 240000 6581	300310	宜通世纪	2020-06-24	2020-07- 22	5.60	25,700.00	143,920.00
202006 240000 6583	002185	华天科技	2020-06-24	2020-07- 22	13.53	30,000.00	405,900.00
202006 240000 6591	002156	通富微电	2020-06-24	2020-07- 22	25.05	17,400.00	435,870.00
202006 240000 6599	600360	华微电子	2020-06-24	2020-07- 22	8.64	25,700.00	222,048.00
202006 290000 0175	000021	深科技	2020-06-29	2020-07- 27	21.83	14,700.00	320,901.00
202006 290000 0207	000158	常山北明	2020-06-29	2020-07- 27	10.44	20,500.00	214,020.00
202006 290000 0318	000970	中科三环	2020-06-29	2020-07- 27	9.78	17,600.00	172,128.00
202006 290000 0333	000988	华工科技	2020-06-29	2020-07- 27	24.43	17,600.00	429,968.00
202006 290000 0373	002079	苏州固锴	2020-06-29	2020-07- 27	13.17	40,000.00	526,800.00
202006 290000 0409	002138	顺络电子	2020-06-29	2020-07- 27	24.95	11,700.00	291,915.00
202006 290000 0412	002152	广电运通	2020-06-29	2020-07- 27	12.94	23,500.00	304,090.00
202006 290000 0417	002174	游族网络	2020-06-29	2020-07- 27	26.08	20,000.00	521,600.00
202006 290000 0424	002185	华天科技	2020-06-29	2020-07- 27	13.53	40,000.00	541,200.00

202006 290000 0431	002217	合力泰	2020-06-29	2020-07- 27	5.25	38,100.00	200,025.00
202006 290000 0466	002373	千方科技	2020-06-29	2020-07- 27	23.99	14,700.00	352,653.00
202006 290000 0560	002745	木林森	2020-06-29	2020-07- 13	15.41	30,000.00	462,300.00
202006 290000 0585	300010	立思辰	2020-06-29	2020-07- 27	19.57	14,700.00	287,679.00
202006 290000 0609	300017	网宿科技	2020-06-29	2020-07- 27	8.49	38,100.00	323,469.00
202006 290000 0639	300088	长信科技	2020-06-29	2020-07- 27	11.20	49,900.00	558,880.00
202006 290000 0644	300115	长盈精密	2020-06-29	2020-07- 27	22.85	11,700.00	267,345.00
202006 290000 0663	300168	万达信息	2020-06-29	2020-07- 27	22.07	17,600.00	388,432.00
202006 290000 0676	300166	东方国信	2020-06-29	2020-07- 27	12.41	17,600.00	218,416.00
202006 290000 0704	300271	华宇软件	2020-06-29	2020-07- 27	28.21	11,700.00	330,057.00
202006 290000 0716	300296	利亚德	2020-06-29	2020-07- 27	6.07	35,200.00	213,664.00
202006 290000 0719	300315	掌趣科技	2020-06-29	2020-07- 27	7.33	55,700.00	408,281.00
202006 290000 0725	300324	旋极信息	2020-06-29	2020-07- 27	6.66	23,500.00	156,510.00
202006 290000 0738	300418	昆仑万维	2020-06-29	2020-07- 27	24.96	17,600.00	439,296.00
202006 290000	600728	佳都科技	2020-06-29	2020-07- 27	9.11	29,300.00	266,923.00

0817							
202006 290000 1075	600460	士兰微	2020-06-29	2020-07- 27	14.68	14,700.00	215,796.00
202006 290000 1299	600667	太极实业	2020-06-29	2020-07- 27	11.82	26,400.00	312,048.00
202006 290000 3734	000066	中国长城	2020-06-29	2020-07- 27	13.20	30,000.00	396,000.00
202006 290000 3744	002222	福晶科技	2020-06-29	2020-07- 27	15.34	20,000.00	306,800.00
202006 290000 3750	002600	领益智造	2020-06-29	2020-07- 27	10.63	10,000.00	106,300.00
202006 290000 3754	002618	丹邦科技	2020-06-29	2020-07- 27	9.65	50,000.00	482,500.00
202006 290000 3758	600584	长电科技	2020-06-29	2020-07- 27	31.27	30,000.00	938,100.00
合计	-	-	-	-	-	4,651,300.0 0	74,020,014. 00

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交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

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	1,419,500.00	567,800.00
未评级	-	-
合计	1,419,500.00	567,800.00

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	8,151,725.57	-	-	-	8,151,725.57
结算备付金	630,095.70	-	-	-	630,095.70
存出保证金	52,901.68	-	-	-	52,901.68
交易性金融资产	1,419,500.00	-	-	1,796,528,302.98	1,797,947,802.98
应收证券清算款	-	-	-	1,379,080.91	1,379,080.91
应收利息	-	-	-	43,351.66	43,351.66
应收股利	-	-	-	27,280.03	27,280.03
资产总计	10,254,222.95	-	-	1,797,978,015.58	1,808,232,238.53
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	588,587.75	588,587.75
应付管理人报酬	-	-	-	750,145.44	750,145.44
应付托管费	-	-	-	150,029.09	150,029.09
应付交易费用	-	-	-	615,748.41	615,748.41
应交税费	-	-	-	3,349.21	3,349.21
其他负债	-	-	-	1,303,008.61	1,303,008.61

负债总计	-	-	-	3,410,868.51	3,410,868.51
利率敏感度缺口	10,254,222.95	-	-	1,794,567,147.07	1,804,821,370.02
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	24,835,040.49	-	-	-	24,835,040.49
结算备付金	431,870.96	-	-	-	431,870.96
存出保证金	77,654.55	-	-	-	77,654.55
交易性金融资产	567,800.00	-	-	1,411,743,818.95	1,412,311,618.95
应收证券清算款	-	-	-	1,041,681.33	1,041,681.33
应收利息	-	-	-	6,145.63	6,145.63
资产总计	25,912,366.00	-	-	1,412,791,645.91	1,438,704,011.91
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	471,717.40	471,717.40
应付管理人报酬	-	-	-	658,149.81	658,149.81
应付托管费	-	-	-	131,629.98	131,629.98
应付交易费用	-	-	-	339,398.91	339,398.91
应交税费	-	-	-	54.23	54.23
其他负债	-	-	-	1,980,716.20	1,980,716.20
负债总计	-	-	-	3,581,666.53	3,581,666.53
利率敏感度缺口	25,912,366.00	-	-	1,409,209,979.38	1,435,122,345.38

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末持有的债券占基金资产净值较小，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	1,796,528,302.98	99.54	1,411,743,818.95	98.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,419,500.00	0.08	567,800.00	0.04
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	1,797,947,802.98	99.62	1,412,311,618.95	98.41

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	101,972,407.41	104,982,375.49
业绩比较基准下降 5%	-101,972,407.41	-104,982,375.49	

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 1,783,794,883.34 元，属于第二层次的余额为人民币 14,152,919.64 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 1,400,424,948.79 元，属于第二层次的余额为人民币 11,886,670.16 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	1,796,528,302.98	99.35
	其中：股票	1,796,528,302.98	99.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,419,500.00	0.08
	其中：债券	1,419,500.00	0.08
	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	8,781,821.27	0.49
8	其他各项资产	1,502,614.28	0.08
9	合计	1,808,232,238.53	100.00

注：（1）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。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 74,020,014.00 元，占基金资产净值比例 4.10%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,105,572,955.82	61.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,992,953.32	0.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,486,693.84	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	668,005,043.99	37.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,359,195.60	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,017,720.00	0.06
S	综合	1,086,540.00	0.06
	合计	1,796,521,102.57	99.54

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	002475	立讯精密	1,818,876	93,399,282.60	5.17
2	000725	京东方 A	11,766,100	54,947,687.00	3.04
3	002415	海康威视	1,622,168	49,232,798.80	2.73
4	603986	兆易创新	143,520	33,857,803.20	1.88
5	600588	用友网络	703,614	31,029,377.40	1.72
6	002241	歌尔股份	985,260	28,927,233.60	1.60
7	002410	广联达	393,300	27,413,010.00	1.52
8	600703	三安光电	1,061,976	26,549,400.00	1.47
9	002555	三七互娱	549,500	25,716,600.00	1.42
10	002230	科大讯飞	666,757	24,956,714.51	1.38
11	000938	紫光股份	443,433	19,058,750.34	1.06
12	002371	北方华创	109,443	18,704,903.13	1.04
13	603160	汇顶科技	79,982	17,827,987.80	0.99
14	603019	中科曙光	452,708	17,383,987.20	0.96
15	000977	浪潮信息	437,854	17,155,119.72	0.95
16	002602	世纪华通	1,081,800	16,562,358.00	0.92
17	002624	完美世界	281,962	16,163,289.68	0.90
18	300433	蓝思科技	572,945	16,065,377.80	0.89
19	600584	长电科技	486,363	15,208,571.01	0.84
20	603501	韦尔股份	75,300	15,206,835.00	0.84
21	002456	欧菲光	818,950	15,060,490.50	0.83
22	002236	大华股份	783,597	15,052,898.37	0.83
23	300454	深信服	71,375	14,700,395.00	0.81
24	002384	东山精密	489,100	14,648,545.00	0.81
25	600183	生益科技	493,650	14,449,135.50	0.80

26	002049	紫光国微	184,182	13,399,240.50	0.74
27	002008	大族激光	370,330	13,313,363.50	0.74
28	002463	沪电股份	525,099	13,116,973.02	0.73
29	002185	华天科技	956,452	12,940,795.56	0.72
30	002600	领益智造	1,183,940	12,585,282.20	0.70
31	300408	三环集团	452,400	12,531,480.00	0.69
32	300383	光环新网	469,597	12,242,393.79	0.68
33	300661	圣邦股份	39,426	12,026,901.30	0.67
34	002439	启明星辰	285,168	11,997,017.76	0.66
35	300088	长信科技	1,058,893	11,859,601.60	0.66
36	002841	视源股份	113,071	11,252,825.92	0.62
37	002405	四维图新	680,735	11,225,320.15	0.62
38	603444	吉比特	19,561	10,739,184.61	0.60
39	002916	深南电路	61,848	10,360,776.96	0.57
40	600536	中国软件	129,002	10,216,958.40	0.57
41	002065	东华软件	811,200	10,156,224.00	0.56
42	000066	中国长城	763,047	10,072,220.40	0.56
43	300782	卓胜微	24,480	9,933,249.60	0.55
44	002179	中航光电	238,371	9,775,594.71	0.54
45	300496	中科创达	122,172	9,492,764.40	0.53
46	002180	纳思达	278,157	9,154,146.87	0.51
47	002273	水晶光电	529,842	9,081,491.88	0.50
48	000636	风华高科	310,800	9,072,252.00	0.50
49	300315	掌趣科技	1,197,226	8,775,666.58	0.49
50	300418	昆仑万维	355,200	8,748,792.00	0.48
51	000988	华工科技	350,084	8,552,552.12	0.47
52	601360	三六零	440,500	8,065,555.00	0.45
53	300271	华宇软件	283,022	7,984,050.62	0.44
54	300212	易华录	141,759	7,938,504.00	0.44
55	300168	万达信息	359,540	7,935,047.80	0.44
56	600271	航天信息	482,714	7,839,275.36	0.43
57	300308	中际旭创	123,760	7,796,880.00	0.43
58	002373	千方科技	324,109	7,775,374.91	0.43
59	600100	同方股份	1,030,400	7,511,616.00	0.42
60	002156	通富微电	299,833	7,510,816.65	0.42
61	300017	网宿科技	846,563	7,187,319.87	0.40
62	002174	游族网络	270,887	7,064,732.96	0.39
63	002138	顺络电子	280,989	7,010,675.55	0.39
64	002195	二三四五	2,486,769	6,987,820.89	0.39
65	000021	深科技	319,600	6,976,868.00	0.39
66	000050	深天马 A	444,750	6,831,360.00	0.38
67	002152	广电运通	523,839	6,778,476.66	0.38
68	603005	晶方科技	84,676	6,660,614.16	0.37
69	002436	兴森科技	517,342	6,637,497.86	0.37

70	600667	太极实业	561,300	6,634,566.00	0.37
71	600845	宝信软件	110,750	6,543,110.00	0.36
72	600410	华胜天成	475,774	6,470,526.40	0.36
73	002402	和而泰	397,710	6,446,879.10	0.36
74	300502	新易盛	99,460	6,277,915.20	0.35
75	601231	环旭电子	285,560	6,236,630.40	0.35
76	002690	美亚光电	116,800	6,143,680.00	0.34
77	300223	北京君正	58,509	5,905,898.46	0.33
78	300010	立思辰	300,457	5,879,943.49	0.33
79	002123	梦网集团	284,400	5,631,120.00	0.31
80	600728	佳都科技	607,246	5,532,011.06	0.31
81	002153	石基信息	140,900	5,499,327.00	0.30
82	002938	鹏鼎控股	109,701	5,491,632.06	0.30
83	002268	卫士通	254,926	5,440,120.84	0.30
84	300115	长盈精密	236,359	5,400,803.15	0.30
85	300346	南大光电	123,333	5,318,118.96	0.29
86	300002	神州泰岳	852,886	5,279,364.34	0.29
87	300379	东方通	121,919	5,246,174.57	0.29
88	300226	上海钢联	66,470	5,224,542.00	0.29
89	300598	诚迈科技	28,360	5,175,292.00	0.29
90	000997	新大陆	319,812	5,110,595.76	0.28
91	000413	东旭光电	1,904,015	5,083,720.05	0.28
92	600446	金证股份	261,908	5,081,015.20	0.28
93	002387	维信诺	355,265	5,073,184.20	0.28
94	600460	士兰微	343,000	5,035,240.00	0.28
95	300036	超图软件	195,462	4,921,733.16	0.27
96	300476	胜宏科技	203,590	4,896,339.50	0.27
97	300369	绿盟科技	208,733	4,861,391.57	0.27
98	603881	数据港	44,703	4,831,053.21	0.27
99	603000	人民网	239,502	4,749,324.66	0.26
100	300296	利亚德	773,615	4,695,843.05	0.26
101	002368	太极股份	106,717	4,662,465.73	0.26
102	002558	巨人网络	264,221	4,597,445.40	0.25
103	300113	顺网科技	180,526	4,585,360.40	0.25
104	300166	东方国信	366,314	4,545,956.74	0.25
105	300674	宇信科技	103,200	4,453,080.00	0.25
106	002214	大立科技	157,606	4,441,337.08	0.25
107	300747	锐科激光	40,700	4,429,381.00	0.25
108	300567	精测电子	64,000	4,368,000.00	0.24
109	000158	常山北明	415,300	4,335,732.00	0.24
110	002425	凯撒文化	246,640	4,330,998.40	0.24
111	600718	东软集团	376,314	4,327,611.00	0.24
112	002217	合力泰	811,516	4,260,459.00	0.24
113	600171	上海贝岭	244,200	4,244,196.00	0.24

114	300348	长亮科技	221,075	4,200,425.00	0.23
115	300188	美亚柏科	210,688	4,177,943.04	0.23
116	000034	神州数码	169,500	4,125,630.00	0.23
117	300078	思创医惠	301,327	4,076,954.31	0.23
118	002036	联创电子	323,060	4,038,250.00	0.22
119	002912	中新赛克	24,206	3,959,859.54	0.22
120	300766	每日互动	103,000	3,920,180.00	0.22
121	603228	景旺电子	109,871	3,866,360.49	0.21
122	600797	浙大网新	455,021	3,749,373.04	0.21
123	002063	远光软件	293,735	3,709,873.05	0.21
124	300458	全志科技	99,255	3,652,584.00	0.20
125	600563	法拉电子	58,446	3,611,962.80	0.20
126	000970	中科三环	369,029	3,609,103.62	0.20
127	600206	有研新材	257,500	3,597,275.00	0.20
128	300352	北信源	503,579	3,550,231.95	0.20
129	000733	振华科技	157,857	3,550,203.93	0.20
130	000503	国新健康	312,100	3,476,794.00	0.19
131	300031	宝通科技	138,400	3,465,536.00	0.19
132	600330	天通股份	347,540	3,464,973.80	0.19
133	002635	安洁科技	138,453	3,447,479.70	0.19
134	300666	江丰电子	57,600	3,437,568.00	0.19
135	300324	旋极信息	534,121	3,428,245.86	0.19
136	002745	木林森	222,300	3,425,643.00	0.19
137	300373	扬杰科技	101,413	3,399,363.76	0.19
138	600633	浙数文化	343,259	3,357,073.02	0.19
139	300395	菲利华	101,691	3,342,583.17	0.19
140	300659	中孚信息	55,580	3,335,911.60	0.18
141	603678	火炬电子	117,500	3,292,350.00	0.18
142	000851	高鸿股份	394,156	3,259,670.12	0.18
143	000555	神州信息	211,661	3,255,346.18	0.18
144	002106	莱宝高科	247,235	3,248,667.90	0.18
145	300709	精研科技	33,690	3,239,293.50	0.18
146	300572	安车检测	49,820	3,166,061.00	0.18
147	300525	博思软件	85,550	3,145,673.50	0.17
148	002815	崇达技术	154,800	3,131,604.00	0.17
149	600601	方正科技	950,300	3,126,487.00	0.17
150	300456	赛微电子	110,779	3,059,715.98	0.17
151	300394	天孚通信	51,287	3,054,140.85	0.17
152	600131	国网信通	157,100	2,980,187.00	0.17
153	300738	奥飞数据	51,540	2,972,827.20	0.16
154	300170	汉得信息	306,653	2,950,001.86	0.16
155	002079	苏州固锴	222,700	2,932,959.00	0.16
156	600360	华微电子	338,735	2,926,670.40	0.16
157	300038	数知科技	355,100	2,897,616.00	0.16

158	300339	润和软件	277,700	2,879,749.00	0.16
159	300523	辰安科技	60,480	2,832,883.20	0.16
160	300327	中颖电子	85,888	2,782,771.20	0.15
161	600640	号百控股	138,700	2,767,065.00	0.15
162	002261	拓维信息	335,400	2,736,864.00	0.15
163	002859	洁美科技	90,500	2,713,190.00	0.15
164	600850	华东电脑	110,501	2,708,379.51	0.15
165	300459	金科文化	769,854	2,655,996.30	0.15
166	300053	欧比特	243,550	2,644,953.00	0.15
167	603613	国联股份	27,865	2,619,310.00	0.15
168	600756	浪潮软件	141,405	2,615,992.50	0.14
169	002421	达实智能	671,120	2,603,945.60	0.14
170	300623	捷捷微电	85,708	2,575,525.40	0.14
171	300663	科蓝软件	92,550	2,564,560.50	0.14
172	002777	久远银海	82,690	2,514,602.90	0.14
173	002449	国星光电	216,043	2,506,098.80	0.14
174	300735	光弘科技	134,942	2,489,679.90	0.14
175	300085	银之杰	154,473	2,474,657.46	0.14
176	600751	海航科技	783,200	2,451,416.00	0.14
177	600363	联创光电	154,900	2,399,401.00	0.13
178	600562	国睿科技	161,663	2,395,845.66	0.13
179	300319	麦捷科技	212,885	2,365,152.35	0.13
180	002222	福晶科技	150,100	2,302,534.00	0.13
181	002168	惠程科技	279,800	2,297,158.00	0.13
182	603258	电魂网络	41,300	2,294,628.00	0.13
183	300303	聚飞光电	388,300	2,287,087.00	0.13
184	300020	银江股份	199,740	2,277,036.00	0.13
185	300624	万兴科技	28,080	2,260,440.00	0.13
186	000823	超声电子	162,009	2,253,545.19	0.12
187	002055	得润电子	146,701	2,209,317.06	0.12
188	300602	飞荣达	66,069	2,168,384.58	0.12
189	002649	博彦科技	228,589	2,125,877.70	0.12
190	300377	赢时胜	224,287	2,094,840.58	0.12
191	300331	苏大维格	68,901	2,087,011.29	0.12
192	300232	洲明科技	256,160	2,072,334.40	0.11
193	300287	飞利信	498,286	2,067,886.90	0.11
194	002376	新北洋	202,919	2,067,744.61	0.11
195	300468	四方精创	87,141	2,065,241.70	0.11
196	300259	新天科技	356,340	2,059,645.20	0.11
197	002530	金财互联	168,200	2,058,768.00	0.11
198	002161	远望谷	257,116	2,056,928.00	0.11
199	002104	恒宝股份	241,600	2,056,016.00	0.11
200	603888	新华网	91,350	2,042,586.00	0.11
201	600602	云赛智联	280,300	2,034,978.00	0.11

202	002139	拓邦股份	357,076	2,010,337.88	0.11
203	300390	天华超净	144,241	2,009,277.13	0.11
204	300075	数字政通	151,001	2,000,763.25	0.11
205	002655	共达电声	157,700	1,996,482.00	0.11
206	002544	杰赛科技	151,395	1,990,844.25	0.11
207	002484	江海股份	214,261	1,986,199.47	0.11
208	300131	英唐智控	371,208	1,982,250.72	0.11
209	000032	深桑达 A	90,900	1,977,075.00	0.11
210	603533	掌阅科技	51,700	1,971,321.00	0.11
211	300299	富春股份	216,990	1,963,759.50	0.11
212	000676	智度股份	229,260	1,957,880.40	0.11
213	300672	国科微	38,060	1,956,664.60	0.11
214	300184	力源信息	306,500	1,949,340.00	0.11
215	002093	国脉科技	220,114	1,948,008.90	0.11
216	002298	中电兴发	239,600	1,947,948.00	0.11
217	300679	电连技术	60,888	1,947,198.24	0.11
218	002517	恺英网络	560,444	1,927,927.36	0.11
219	300465	高伟达	136,262	1,891,316.56	0.10
220	603636	南威软件	155,166	1,877,508.60	0.10
221	002308	威创股份	276,472	1,877,244.88	0.10
222	300455	康拓红外	125,800	1,868,130.00	0.10
223	002197	证通电子	178,115	1,843,490.25	0.10
224	300256	星星科技	290,051	1,838,923.34	0.10
225	002338	奥普光电	62,500	1,826,250.00	0.10
226	300248	新开普	147,127	1,818,489.72	0.10
227	002657	中科金财	116,598	1,810,766.94	0.10
228	300657	弘信电子	90,216	1,810,635.12	0.10
229	002869	金溢科技	27,400	1,810,592.00	0.10
230	300229	拓尔思	157,004	1,802,405.92	0.10
231	603328	依顿电子	172,082	1,794,815.26	0.10
232	002609	捷顺科技	140,702	1,793,950.50	0.10
233	300552	万集科技	41,900	1,784,102.00	0.10
234	603920	世运电路	71,500	1,772,485.00	0.10
235	300130	新国都	127,464	1,752,630.00	0.10
236	600288	大恒科技	152,943	1,749,667.92	0.10
237	600552	凯盛科技	264,700	1,720,550.00	0.10
238	300448	浩云科技	179,955	1,718,570.25	0.10
239	300310	宜通世纪	305,781	1,712,373.60	0.09
240	300349	金卡智能	111,574	1,679,188.70	0.09
241	300604	长川科技	54,086	1,665,307.94	0.09
242	300007	汉威科技	100,647	1,663,694.91	0.09
243	300613	富瀚微	14,500	1,642,850.00	0.09
244	002803	吉宏股份	65,700	1,638,558.00	0.09
245	300047	天源迪科	222,405	1,614,660.30	0.09

246	300209	天泽信息	93,701	1,607,909.16	0.09
247	002618	丹邦科技	165,501	1,597,084.65	0.09
248	300044	赛为智能	237,799	1,595,631.29	0.09
249	002279	久其软件	217,432	1,576,382.00	0.09
250	300386	飞天诚信	92,043	1,575,776.16	0.09
251	300202	聚龙股份	144,580	1,554,235.00	0.09
252	002474	榕基软件	217,401	1,550,069.13	0.09
253	603068	博通集成	18,900	1,522,962.00	0.08
254	603890	春秋电子	84,212	1,513,289.64	0.08
255	002876	三利谱	28,310	1,497,599.00	0.08
256	300494	盛天网络	62,700	1,495,395.00	0.08
257	600855	航天长峰	94,000	1,494,600.00	0.08
258	300559	佳发教育	69,690	1,478,821.80	0.08
259	300531	优博讯	70,400	1,464,320.00	0.08
260	300114	中航电测	128,300	1,463,903.00	0.08
261	300311	任子行	207,505	1,462,910.25	0.08
262	603186	华正新材	29,200	1,453,284.00	0.08
263	300366	创意信息	158,400	1,441,440.00	0.08
264	300220	金运激光	31,400	1,425,874.00	0.08
265	603660	苏州科达	154,732	1,418,892.44	0.08
266	002947	恒铭达	22,100	1,414,400.00	0.08
267	300603	立昂技术	48,170	1,412,826.10	0.08
268	002119	康强电子	113,530	1,406,636.70	0.08
269	300245	天玑科技	136,800	1,406,304.00	0.08
270	600571	信雅达	153,601	1,396,233.09	0.08
271	603936	博敏电子	94,376	1,393,933.52	0.08
272	603559	中通国脉	62,200	1,388,304.00	0.08
273	002017	东信和平	115,900	1,381,528.00	0.08
274	300102	乾照光电	306,832	1,380,744.00	0.08
275	300231	银信科技	154,776	1,379,054.16	0.08
276	300785	值得买	10,910	1,371,496.10	0.08
277	300065	海兰信	138,900	1,366,776.00	0.08
278	300081	恒信东方	159,530	1,359,195.60	0.08
279	300368	汇金股份	139,101	1,342,324.65	0.07
280	300066	三川智慧	271,750	1,337,010.00	0.07
281	300046	台基股份	64,860	1,312,117.80	0.07
282	300297	蓝盾股份	326,098	1,307,652.98	0.07
283	300302	同有科技	103,202	1,307,569.34	0.07
284	300571	平治信息	28,250	1,305,150.00	0.07
285	300333	兆日科技	146,803	1,302,142.61	0.07
286	300043	星辉娱乐	324,500	1,298,000.00	0.07
287	603220	中贝通信	73,900	1,293,250.00	0.07
288	002288	超华科技	284,600	1,292,084.00	0.07
289	300773	拉卡拉	37,100	1,289,967.00	0.07

290	300323	华灿光电	236,400	1,288,380.00	0.07
291	300541	先进数通	71,979	1,281,945.99	0.07
292	000948	南天信息	98,020	1,273,279.80	0.07
293	300096	易联众	150,201	1,272,202.47	0.07
294	300300	汉鼎宇佑	206,725	1,250,686.25	0.07
295	002579	中京电子	87,200	1,246,960.00	0.07
296	603267	鸿远电子	28,620	1,237,815.00	0.07
297	603383	顶点软件	27,700	1,235,143.00	0.07
298	603626	科森科技	101,600	1,234,440.00	0.07
299	002528	英飞拓	260,600	1,230,032.00	0.07
300	300227	光韵达	116,840	1,225,651.60	0.07
301	300579	数字认证	29,750	1,211,717.50	0.07
302	300776	帝尔激光	14,400	1,206,432.00	0.07
303	300513	恒实科技	93,760	1,201,065.60	0.07
304	300570	太辰光	59,760	1,195,200.00	0.07
305	002913	奥士康	20,100	1,191,528.00	0.07
306	002619	艾格拉斯	479,500	1,189,160.00	0.07
307	300416	苏试试验	52,500	1,187,025.00	0.07
308	300128	锦富技术	380,067	1,166,805.69	0.06
309	603927	中科软	19,300	1,166,492.00	0.06
310	300205	天喻信息	111,425	1,158,820.00	0.06
311	002636	金安国纪	126,473	1,152,169.03	0.06
312	300634	彩讯股份	51,600	1,147,068.00	0.06
313	002137	麦达数字	151,516	1,145,460.96	0.06
314	603508	思维列控	34,000	1,143,760.00	0.06
315	300533	冰川网络	31,550	1,141,479.00	0.06
316	300493	润欣科技	124,150	1,129,765.00	0.06
317	603232	格尔软件	36,172	1,114,097.60	0.06
318	002177	御银股份	265,000	1,113,000.00	0.06
319	603189	网达软件	47,200	1,112,504.00	0.06
320	300378	鼎捷软件	81,643	1,110,344.80	0.06
321	002095	生意宝	54,513	1,101,162.60	0.06
322	000532	华金资本	91,000	1,086,540.00	0.06
323	300241	瑞丰光电	185,600	1,074,624.00	0.06
324	002587	奥拓电子	188,403	1,073,897.10	0.06
325	002401	中远海科	67,400	1,073,682.00	0.06
326	002929	润建股份	37,100	1,068,109.00	0.06
327	300365	恒华科技	104,300	1,063,860.00	0.06
328	300682	朗新科技	62,000	1,055,240.00	0.06
329	300686	智动力	43,500	1,046,610.00	0.06
330	300671	富满电子	35,720	1,038,737.60	0.06
331	300288	朗玛信息	89,200	1,037,396.00	0.06
332	300148	天舟文化	257,000	1,017,720.00	0.06
333	300706	阿石创	29,100	999,876.00	0.06

334	300449	汉邦高科	104,180	984,501.00	0.05
335	002189	中光学	56,714	982,853.62	0.05
336	002315	焦点科技	66,488	953,437.92	0.05
337	300099	精准信息	173,001	949,775.49	0.05
338	002453	华软科技	198,900	948,753.00	0.05
339	300290	荣科科技	150,950	947,966.00	0.05
340	603133	碳元科技	54,377	944,528.49	0.05
341	300768	迪普科技	20,000	925,800.00	0.05
342	603516	淳中科技	24,200	923,956.00	0.05
343	002464	众应互联	158,337	908,854.38	0.05
344	300462	华铭智能	39,848	903,752.64	0.05
345	002955	鸿合科技	29,279	890,081.60	0.05
346	300566	激智科技	33,725	889,665.50	0.05
347	002232	启明信息	89,878	881,703.18	0.05
348	300250	初灵信息	67,000	880,380.00	0.05
349	300050	世纪鼎利	173,001	875,385.06	0.05
350	300341	麦克奥迪	91,300	871,915.00	0.05
351	000606	顺利办	231,800	866,932.00	0.05
352	300042	朗科科技	51,700	862,356.00	0.05
353	603602	纵横通信	52,450	855,984.00	0.05
354	603773	沃格光电	25,800	840,306.00	0.05
355	300687	赛意信息	36,550	836,995.00	0.05
356	300667	必创科技	28,800	831,744.00	0.05
357	603138	海量数据	43,130	831,115.10	0.05
358	300771	智莱科技	21,780	823,284.00	0.05
359	603738	泰晶科技	35,800	819,462.00	0.05
360	603106	恒银科技	87,735	818,567.55	0.05
361	300597	吉大通信	73,400	818,410.00	0.05
362	300052	中青宝	68,754	818,172.60	0.05
363	300480	光力科技	53,700	811,407.00	0.04
364	300799	左江科技	9,300	810,774.00	0.04
365	300560	中富通	40,060	804,404.80	0.04
366	300520	科大国创	42,440	784,715.60	0.04
367	002861	瀛通通讯	27,900	760,833.00	0.04
368	300806	斯迪克	15,900	760,815.00	0.04
369	300701	森霸传感	21,800	759,294.00	0.04
370	600242	*ST 中昌	119,000	755,650.00	0.04
371	603662	柯力传感	16,300	753,875.00	0.04
372	300516	久之洋	24,500	749,210.00	0.04
373	300802	矩子科技	21,800	747,304.00	0.04
374	002845	同兴达	32,700	746,541.00	0.04
375	002819	东方中科	28,600	741,312.00	0.04
376	300282	三盛教育	130,901	735,663.62	0.04
377	300739	明阳电路	35,175	735,509.25	0.04

378	002962	五方光电	30,000	732,900.00	0.04
379	300691	联合光电	48,157	731,023.26	0.04
380	603679	华体科技	18,500	727,235.00	0.04
381	002937	兴瑞科技	50,600	714,472.00	0.04
382	300249	依米康	113,400	709,884.00	0.04
383	002388	新亚制程	88,600	709,686.00	0.04
384	000662	*ST 天夏	285,262	707,449.76	0.04
385	600876	洛阳玻璃	52,000	703,560.00	0.04
386	300561	汇金科技	43,086	696,700.62	0.04
387	002960	青鸟消防	29,800	694,936.00	0.04
388	300356	光一科技	123,902	693,851.20	0.04
389	002199	东晶电子	85,500	693,405.00	0.04
390	002866	传艺科技	42,430	689,487.50	0.04
391	300632	光莆股份	40,340	683,763.00	0.04
392	002881	美格智能	24,700	677,768.00	0.04
393	300306	远方信息	71,900	656,447.00	0.04
394	300790	宇瞳光学	28,000	654,920.00	0.04
395	300127	银河磁体	41,102	651,466.70	0.04
396	300708	聚灿光电	44,400	651,348.00	0.04
397	300410	正业科技	98,074	650,230.62	0.04
398	300787	海能实业	17,300	648,750.00	0.04
399	300678	中科信息	29,760	627,340.80	0.03
400	603327	福蓉科技	23,700	612,171.00	0.03
401	300812	易天股份	10,600	608,758.00	0.03
402	300469	信息发展	53,014	568,310.08	0.03
403	300542	新晨科技	51,625	567,875.00	0.03
404	300155	安居宝	94,200	564,258.00	0.03
405	603115	海星股份	28,300	534,304.00	0.03
406	300810	中科海讯	10,700	532,432.00	0.03
407	603322	超讯通信	28,396	530,721.24	0.03
408	300532	今天国际	59,120	529,124.00	0.03
409	300162	雷曼光电	76,500	518,670.00	0.03
410	300446	乐凯新材	55,700	512,440.00	0.03
411	300417	南华仪器	28,200	509,856.00	0.03
412	603256	宏和科技	42,300	483,912.00	0.03
413	002885	京泉华	29,750	449,522.50	0.02
414	002855	捷荣技术	42,800	448,972.00	0.02
415	603386	广东骏亚	27,900	398,133.00	0.02
416	002952	亚世光电	22,363	394,930.58	0.02
417	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.02
418	300789	唐源电气	6,300	372,645.00	0.02
419	603933	睿能科技	27,392	357,739.52	0.02
420	300647	超频三	45,750	350,445.00	0.02
421	688181	八亿时空	4,306	263,053.54	0.01

422	601519	大智慧	26,900	216,814.00	0.01
423	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
424	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
425	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
426	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
427	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
428	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
429	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
430	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
431	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
432	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
433	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
434	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
435	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
436	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600570	恒生电子	33,374,038.73	2.33
2	603986	兆易创新	31,642,015.50	2.20
3	600703	三安光电	28,176,589.72	1.96
4	600588	用友网络	26,686,915.06	1.86
5	603160	汇顶科技	24,111,805.67	1.68
6	600584	长电科技	17,065,625.43	1.19
7	002602	世纪华通	16,981,563.16	1.18
8	600183	生益科技	16,306,892.55	1.14
9	603019	中科曙光	15,663,971.35	1.09
10	603501	韦尔股份	13,059,561.02	0.91
11	600271	航天信息	12,643,333.65	0.88
12	600536	中国软件	11,545,086.32	0.80
13	600100	同方股份	10,991,688.97	0.77
14	000725	京东方 A	10,688,195.00	0.74
15	601360	三六零	10,270,226.85	0.72
16	002841	视源股份	9,139,075.91	0.64
17	600728	佳都科技	7,291,282.00	0.51
18	601231	环旭电子	7,225,188.56	0.50
19	600460	士兰微	7,175,078.08	0.50

20	600667	太极实业	7,017,543.00	0.49
----	--------	------	--------------	------

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	600570	恒生电子	68,665,261.34	4.78
2	600703	三安光电	28,327,314.66	1.97
3	600588	用友网络	28,027,820.84	1.95
4	603986	兆易创新	24,288,713.72	1.69
5	603160	汇顶科技	19,002,738.43	1.32
6	600183	生益科技	16,208,565.61	1.13
7	600584	长电科技	15,265,271.62	1.06
8	603501	韦尔股份	13,876,940.76	0.97
9	603019	中科曙光	13,749,631.08	0.96
10	300033	同花顺	12,396,938.52	0.86
11	600271	航天信息	11,686,449.42	0.81
12	600536	中国软件	11,386,796.22	0.79
13	600100	同方股份	10,100,800.68	0.70
14	600845	宝信软件	9,189,734.62	0.64
15	002414	高德红外	7,955,039.92	0.55
16	600410	华胜天成	7,208,250.00	0.50
17	601231	环旭电子	6,933,077.10	0.48
18	600460	士兰微	6,740,302.00	0.47
19	603005	晶方科技	6,474,940.00	0.45
20	600728	佳都科技	6,362,380.00	0.44

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	777,362,080.22
卖出股票收入（成交）总额	617,643,227.90

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）	1,419,500.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,419,500.00	0.08

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	128112	歌尔转 2	14,195	1,419,500.00	0.08

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，广联达科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京市海淀区卫生健康委员会的处罚。

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	52,901.68
2	应收证券清算款	1,379,080.91
3	应收股利	27,280.03
4	应收利息	43,351.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,502,614.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600703	三安光电	250,000.00	0.01	转融通出借 流通受限

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	
		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
16,876	75,777.91	911,321,982.00	71.26%	367,506,071.00	28.74%	674,967,124.00	52.78%

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“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	创金合信基金-华夏银行-创金合信华睿2号集合资产管理计划	73,803,950.00	5.77%

2	华夏基金-中央汇金资产管理有限责任公司-华夏基金-汇金资管单一资产管理计划	38,235,800.00	2.99%
3	华夏基金-华夏银行-华夏银行股份有限公司	34,182,500.00	2.67%
4	中国石油天然气集团有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	33,787,000.00	2.64%
5	上海浦东发展银行股份有限公司-农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	4,600,000.00	0.36%
6	全球人寿保险股份有限公司-自有资金	3,668,600.00	0.29%
7	方正证券股份有限公司	3,450,063.00	0.27%
8	中国建设银行股份有限公司-长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	3,300,100.00	0.26%
9	鑫牛润赢(天津)股权投资基金管理有限公司	2,812,000.00	0.22%
10	古春辉	2,600,000.00	0.20%
11	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	674,967,124.00	52.78%

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（2015 年 1 月 8 日）基金份额总额	354,828,053.00
本报告期期初基金份额总额	1,242,828,053.00
本报告期基金总申购份额	1,496,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,460,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,278,828,053.00

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	
安信证券	1	2,027,000.00	0.15%	1,511.96	0.14%	-
华西证券	1	35,186,916.14	2.54%	25,732.27	2.45%	-
海通证券	2	65,014,902.05	4.69%	47,544.43	4.53%	-
长江证券	2	97,012,859.02	7.00%	70,945.59	6.77%	新增 2 个
广发证券	3	176,260,464.09	12.71%	163,531.38	15.60%	-
中信证券	3	256,792,959.73	18.52%	187,793.31	17.91%	-
银河证券	2	754,041,711.15	54.39%	551,426.43	52.59%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华金证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
招商证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	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
安信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	82,025.00	1.86%	-	-	-	-
广发证券	3,057,184.30	69.34%	-	-	-	-
中信证券	1,269,470.01	28.79%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加中信建投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	2020-03-12
6	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
7	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
8	关于广发中证全指信息技术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	2020-02-26
9	关于广发中证全指信息技术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	2020-01-22
10	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
11	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
12	关于广发中证全指信息技术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	2020-01-10

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
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金	1	20200101-20200630	558,062,537.00	743,867,200.00	626,962,613.00	674,967,124.00	52.78%

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信息技术交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- （二）《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照

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