

**华夏沪深 300 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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十九日

## §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 27 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.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	98
7.1 期末基金资产组合情况.....	98
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	99
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.....	100
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	107
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	109
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.....	109
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.....	109
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.....	109
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.....	109
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	109
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	110
7.12 投资组合报告附注.....	110
§8 基金份额持有人信息.....	111
§9 开放式基金份额变动.....	112
§10 重大事件揭示.....	112
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	115
§12 备查文件目录.....	115

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300（扩位证券简称：300ETF 基金）
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	6,441,549,828 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 1 月 16 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	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 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		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 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	1,908,199,065.60
本期利润	879,936,725.25
加权平均基金份额本期利润	0.1191
本期加权平均净值利润率	3.01%
本期基金份额净值增长率	2.46%
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	11,315,968,049.19
期末可供分配基金份额利润	1.7567
期末基金资产净值	27,052,940,516.64
期末基金份额净值	4.1998
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	99.07%

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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.36%	0.90%	7.68%	0.90%	0.68%	0.00%
过去三个月	13.97%	0.90%	12.96%	0.90%	1.01%	0.00%
过去六个月	2.46%	1.52%	1.64%	1.52%	0.82%	0.00%

过去一年	10.66%	1.22%	8.85%	1.22%	1.81%	0.00%
过去三年	19.23%	1.25%	13.56%	1.25%	5.67%	0.00%
过去五年	4.03%	1.45%	-6.91%	1.45%	10.94%	0.00%
自基金合同生效起至今	99.07%	1.47%	74.87%	1.48%	24.20%	-0.01%

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

华夏沪深 300 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  
 (2012 年 12 月 25 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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中

日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，2020 年在基金分类排名中（截至 2020 年 6 月 30 日数据），华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（非 A 类）”中排序 1/123；华夏鼎利债券 (A 类)和华夏鼎沛债券 (A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中分别排序 2/248 和 6/248；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 2/345；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 9/22；华夏创新前沿股票和华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 2/203 和 10/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(A 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排序 5/225；华夏乐享健康混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中排序 5/490；华夏磐泰混合(LOF)在“混合基金-偏债型基金-偏债型基金（A 类）”中分别排序 6/125；华夏移动互联混合 (QDII) 和华夏新时代混合 (QDII) 在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/36 和 7/36；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(C 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 6/21，华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 3/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 7/35 和 4/35；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/53；华夏创成长

ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/17 和 3/17；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 3/28。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端部分基金上线定投止盈功能，同时对资料上传功能进行升级优化，为广大投资者管理定期定额交易、以及业务办理提供了便利；（2）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（3）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“难忘，因为不用记”、“凡是家人，都有户口本”、“人未动，心已跳”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2012-12-25	-	20 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014

					年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间) 等。
赵宗庭	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2017-04-17	-	12 年	对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员, 嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理, 嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。

注: ①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同, 本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合, 制定并严格遵守相应的制度和流程, 通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内, 本基金管理人严格执行了《证

券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，新冠肺炎疫情在全球多点暴发，世界经济遭受重创，为应对严重的市场压力，多国政府和央行迅速采取了大刀阔斧的行动，推出了一揽子财政刺激计划和宽松货币政策。国内方面，面对新冠肺炎疫情带来的严峻考验和复杂多变的国内外环境，全国各地统筹推进疫情防控和经济社会发展，在一系列政策作用下，疫情防控形势不断向好，复工复产、复商复市加快推进，上半年我国经济先降后升，二季度经济增长由负转正，主要指标恢复性增长，整体经济稳步复苏态势明显。

市场方面，全球股市表现不平静，整体呈现先抑后扬走势。A 股市场在经历年初震荡调整后稳步上升，大中小盘指数走势分化，小盘指数走势领先。创业板试点注册制改革、新三板挂牌公司转板上市等措施落地，标志着我国多层次资本市场体系的制度建设取得新的成就。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回、成份股调整、转融通证券出借等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商为中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、国盛证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司等。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 4.1998 元，本报告期份额净值增长率为 2.46%，同

期业绩比较基准增长率 1.64%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.82%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 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，国内上半年经济稳步复苏为下半年持续恢复打下了较为坚实的基础；疫情期间催生了很多诸如远程办公、云计算、人工智能等新业态新模式，为经济回升继续提供有力支撑；财税金融以及就业支持方面的宏观政策效应将进一步显现。当前境外疫情仍在快速蔓延扩散，世界经济重启举步维艰，国内需求恢复仍将受到一定制约，稳企业、保就业仍面临较大压力，但总体来看，下半年以及下一阶段我国经济运行会继续维持向好的态势。

市场方面，由于经济景气确定性上行，盈利向上趋势确定，风险偏好易上难下，A 股市场整体胜率较高，预计下半年将呈现价值风格优于成长风格的局面。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华夏沪深 300 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，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 300 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，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 538,886,437.85 元。

### 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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 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 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	82,199,201.84	55,045,599.63
结算备付金		191,577,122.83	113,851,466.73
存出保证金		23,837,334.05	12,107,123.90
交易性金融资产	6.4.7.2	26,818,379,486.62	31,001,053,152.75
其中：股票投资		26,811,376,986.62	31,000,078,052.75
基金投资		-	-
债券投资		7,002,500.00	975,100.00
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		7,408,379.18	14,353,261.27
应收利息	6.4.7.5	629,932.97	321,655.29
应收股利		2,443,906.80	862,790.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		27,126,475,364.29	31,197,595,049.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		-	-
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		24,381,161.74	20,585,919.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,396,098.44	12,281,487.54
应付托管费		2,279,219.67	2,456,297.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,061,571.39	3,764,149.09
应交税费		154,704.81	25,391.96
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	31,262,091.60	18,468,308.01
负债合计		73,534,847.65	57,581,553.44
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	15,736,972,467.45	18,252,327,823.64
未分配利润	6.4.7.10	11,315,968,049.19	12,887,685,672.49
所有者权益合计		27,052,940,516.64	31,140,013,496.13
负债和所有者权益总计		27,126,475,364.29	31,197,595,049.57

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.1998 元，基金份额总额 6,441,549,828.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 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
<b>一、收入</b>		983,640,620.17	6,276,411,278.76
1.利息收入		5,013,299.21	1,329,766.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,614,818.74	1,286,288.00
债券利息收入		4,445.17	5,643.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	37,835.22
证券出借利息收入		3,394,035.30	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,009,340,765.80	1,396,092,094.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,701,981,472.46	1,087,299,454.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,281,570.25	3,772,952.18
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	7,530,326.21	32,142,932.05
股利收益	6.4.7.17	292,547,396.88	272,876,756.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,028,262,340.35	4,876,571,242.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-2,451,104.49	2,418,175.25
<b>减：二、费用</b>		103,703,894.92	87,972,790.24
1.管理人报酬		72,607,538.06	61,433,738.08
2.托管费		14,521,507.59	12,286,747.57
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	12,059,396.48	10,331,386.80
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		32,753.85	96,444.99
7.其他费用	6.4.7.21	4,482,698.94	3,824,472.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		879,936,725.25	6,188,438,488.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		879,936,725.25	6,188,438,488.52

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 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）	18,252,327,823.64	12,887,685,672.49	31,140,013,496.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	879,936,725.25	879,936,725.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,515,355,356.19	-1,912,767,910.70	-4,428,123,266.89
其中：1.基金申购款	7,532,873,640.31	4,407,211,046.30	11,940,084,686.61
2.基金赎回款	-10,048,228,996.50	-6,319,978,957.00	-16,368,207,953.50
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）	-	-538,886,437.85	-538,886,437.85
五、期末所有者权益（基金净值）	15,736,972,467.45	11,315,968,049.19	27,052,940,516.64
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	18,478,797,755.06	4,331,976,997.39	22,810,774,752.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,188,438,488.52	6,188,438,488.52
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）	-1,510,532,455.59	-683,949,170.30	-2,194,481,625.89
其中：1.基金申购款	6,932,618,385.68	3,433,500,298.51	10,366,118,684.19
2.基金赎回款	-8,443,150,841.27	-4,117,449,468.81	-12,560,600,310.08
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	16,968,265,299.47	9,836,466,315.61	26,804,731,615.08

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：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1653 号《关于核准华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2012 年 12 月 17 日至 2012 年 12 月 19 日期间共募集 602,764,295.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

根据《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份。

#### 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和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内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，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，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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	82,199,201.84
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	82,199,201.84

##### 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	23,458,909,617.16	26,811,376,986.62	3,352,467,369.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,002,500.00	7,002,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	7,002,500.00	7,002,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	23,465,912,117.16	26,818,379,486.62	3,352,467,369.46

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	214,469,700.00	-	-	-
其中：股指期货	214,469,700.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	214,469,700.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见

下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位： 手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	沪深 300 股指期货 IF2007 合约	180	222,372,000.00	7,902,300.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计					7,902,300.00
股指期货投资本期收益					7,530,326.21
股指期货投资本期公允价值变动					2,675,724.00

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	8,709.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	102,822.23
应收债券利息	643.65
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	517,037.91
其他	720.10
合计	629,932.97

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,061,571.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,061,571.39

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	124,316.92
应付指数使用费	2,124,741.70
应退替代款	28,882,856.11
可退替代款	130,176.87
合计	31,262,091.60

## 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	7,471,149,828.00	18,252,327,823.64
本期申购	3,083,400,000.00	7,532,873,640.31
本期赎回（以“-”号填列）	-4,113,000,000.00	-10,048,228,996.50
本期末	6,441,549,828.00	15,736,972,467.45

## 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	18,958,787,917.37	-6,071,102,244.88	12,887,685,672.49
本期利润	1,908,199,065.60	-1,028,262,340.35	879,936,725.25
本期基金份额交易产生的变动数	-2,740,062,628.50	827,294,717.80	-1,912,767,910.70
其中：基金申购款	7,940,931,806.85	-3,533,720,760.55	4,407,211,046.30
基金赎回款	-10,680,994,435.35	4,361,015,478.35	-6,319,978,957.00
本期已分配利润	-538,886,437.85	-	-538,886,437.85
本期末	17,588,037,916.62	-6,272,069,867.43	11,315,968,049.19

## 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
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,288,457.94
其他	10,075.02
合计	1,614,818.74

## 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	1,178,020,274.21
股票投资收益——赎回差价收入	523,961,198.25
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	1,701,981,472.46

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	8,820,743,614.48
减：卖出股票成本总额	7,642,723,340.27
买卖股票差价收入	1,178,020,274.21

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	16,368,207,953.50
减：现金支付赎回款总额	5,991,335,716.50
减：赎回股票成本总额	9,852,911,038.75
赎回差价收入	523,961,198.25

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,960,757.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,675,200.00
减：应收利息总额	3,986.84
买卖债券差价收入	7,281,570.25

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	7,530,326.21
合计	7,530,326.21

#### 6.4.7.17 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	292,547,396.88
其中：证券出借权益补偿收入	4,041,201.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	292,547,396.88

#### 6.4.7.18 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	-1,030,938,064.35
——股票投资	-1,030,938,064.35
——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	2,675,724.00
——权证投资	-
——期货投资	2,675,724.00
4.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	-1,028,262,340.35

## 6.4.7.19 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	-2,451,104.49
合计	-2,451,104.49

## 6.4.7.20 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	12,059,396.48
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	12,059,396.48

## 6.4.7.21 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	64,644.58
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,929.79
指数使用费	4,356,452.23
合计	4,482,698.94

## 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，本基金无或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期不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。

##### 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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏沪深 300ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 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
中信证券	4,017,172,442.40	25.57%	-	-

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 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
中信证券	4,047,254.00	13.07%	-	-

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

## 6.4.10.1.5 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
中信证券	339,202.39	19.67%	324,280.59	7.98%
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

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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	72,607,538.06	61,433,738.08
其中：支付销售机构的客户维护费	90,720.21	-

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

## 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	14,521,507.59	12,286,747.57
----------------	---------------	---------------

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 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

无。

#### 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

单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	940,186,964.00	973,508.67	4,487,700.00	253,736.57

#### 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

无。

##### 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
华夏沪深 300ETF 联接	3,336,392,548.00	51.79%	3,989,471,756.00	53.40%
中信证券	38,919,813.00	0.60%	75,674,253.00	1.01%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

#### 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
中国工商银行活期存款	82,199,201.84	316,285.78	121,638,111.20	337,071.61

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 2,067,757,080.00 元（上年度可比期间：1,651,294,080.00 元），支付给中信期货的佣金为 68,236.37 元（上年度可比期间为：54,492.96 元）。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合计	备注
1	2020-01-14	2020-01-14	0.710	-	-	538,886,437.85	-
合计			0.710	-	-	538,886,437.85	-

#### 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
000063	中 兴 通 讯	2020-04-02	2020-10-02	非 公 开 发 行 流 通 受	38.16	38.32	1,200,000	45,792,000.00	45,984,000.00	-

603986	兆易创新	2020-01-02	2020-07-02	限 非公开发 行流通 受限	134.64	234.34	140,000	18,850,000.00	32,807,600.00	-
002007	华兰生物	2020-05-27	2020-11-27	非公开发 行流通 受限	39.07	46.67	600,000	23,442,000.00	28,002,000.00	-
002352	顺丰控股	2020-01-09	2020-07-09	非公开发 行流通 受限	35.00	54.23	500,000	17,500,000.00	27,115,000.00	-
002602	世纪华通	2020-02-20	2020-08-20	非公开发 行流通 受限	13.32	14.80	1,400,000	18,648,000.00	20,720,000.00	-
603160	汇顶科技	2020-01-10	2020-07-10	非公开发 行流通	202.19	219.54	80,000	16,175,200.00	17,563,200.00	-

				受限							
002624	完美世界	2020-02-27	2020-08-27	非公开发 行流通 受限	45.58	55.86	280,000	12,762,400.00	15,640,800.00	-	
603799	华友钴业	2020-11-28	2020-05-30	非公开发 行流通 受限	29.07	35.24	370,000	10,755,900.00	13,038,800.00	-	
002938	鹏鼎控股	2020-05-06	2020-11-06	非公开发 行流通 受限	39.28	46.03	140,000	5,499,200.00	6,444,200.00	-	
688126	沪硅产业	2020-04-13	2020-10-20	新发流 通受限	3.89	26.34	220,528	857,853.92	5,808,707.52	-	
601360	三六零	2020-03-09	2020-09-09	非公开发 行流通 受限	20.10	17.71	210,000	4,221,000.00	3,719,100.00	-	

688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新发流通受限	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	-
688200	华峰测控	2020-02-11	2020-08-18	新发流通受限	107.41	270.02	3,780	406,009.80	1,020,675.60	-
688085	三友医疗	2020-03-30	2020-10-09	新发流通受限	20.96	67.62	8,807	184,594.72	595,529.34	-
688051	佳华科技	2020-03-12	2020-09-20	新发流通受限	50.81	120.27	4,053	205,932.93	487,454.31	-
688026	洁特生物	2020-01-15	2020-07-22	新发流通受限	16.49	83.32	4,433	73,100.17	369,357.56	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新发流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智	2020-06-24	2020-07-07	新发	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-

	航			流通受限						
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新发流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新发流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新发流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

## 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	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
------	------	-------	------	------	------	--------	----------	--------	--------	----

				限 类 型						
128112	歌 尔 转 2	2020-06-12	2020-07-13	新 发 流 通 受 限	100.00	100.00	54,706	5,470,600.00	5,470,600.00	-
128114	正 邦 转 债	2020-06-17	2020-07-15	新 发 流 通 受 限	100.00	100.00	15,319	1,531,900.00	1,531,900.00	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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
2020060300001229	000063	中 兴 通 讯	2020-06-03	2020-07-01	40.13	650,000.00	26,084,500.00

2020060300001231	000876	新希望	2020-06-03	2020-07-01	29.80	45,000.00	1,341,000.00
2020060300001249	000723	美锦能源	2020-06-03	2020-07-01	6.26	16,000.00	100,160.00
2020060300001315	300433	蓝思科技	2020-06-03	2020-07-01	28.04	186,000.00	5,215,440.00
2020060300001769	000876	新希望	2020-06-03	2020-07-01	29.80	150,000.00	4,470,000.00
2020060400000286	000100	TCL 科技	2020-06-04	2020-07-02	6.20	50,000.00	310,000.00
2020060400000297	000100	TCL 科技	2020-06-04	2020-07-02	6.20	10,000.00	62,000.00
2020060400000300	000333	美的集团	2020-06-04	2020-07-02	59.79	10,000.00	597,900.00
2020060400000314	000651	格力电器	2020-06-04	2020-07-02	56.57	10,000.00	565,700.00
2020060400000318	000538	云南白药	2020-06-04	2020-07-02	93.81	10,000.00	938,100.00
2020060400000323	000723	美锦能源	2020-06-04	2020-07-02	6.26	20,000.00	125,200.00
2020060400000324	000723	美锦能源	2020-06-04	2020-07-02	6.26	70,000.00	438,200.00
2020060400000340	000858	五粮液	2020-06-04	2020-07-02	171.12	10,000.00	1,711,200.00
2020060400000342	000895	双	2020-06-04	2020-07-02	46.09	10,000.00	460,900.00

		汇发展					
2020060400000400	002236	大华股份	2020-06-04	2020-07-02	19.21	120,000.00	2,305,200.00
2020060400000458	002460	赣锋锂业	2020-06-04	2020-07-02	53.57	15,000.00	803,550.00
2020060400000499	002939	长城证券	2020-06-04	2020-07-02	12.32	10,000.00	123,200.00
2020060400000505	300003	乐普医疗	2020-06-04	2020-07-02	36.52	10,000.00	365,200.00
2020060400000511	300015	爱尔眼科	2020-06-04	2020-07-02	43.45	10,000.00	434,500.00
2020060400002515	002773	康弘药业	2020-06-04	2020-07-02	49.60	21,000.00	1,041,600.00
2020060400002527	002558	巨人网络	2020-06-04	2020-07-02	17.40	47,000.00	817,800.00
2020060400002841	000063	中兴通讯	2020-06-04	2020-07-02	40.13	63,000.00	2,528,190.00
2020060400002859	002460	赣锋锂业	2020-06-04	2020-07-02	53.57	10,000.00	535,700.00
2020060400002863	000100	TCL 科技	2020-06-04	2020-07-02	6.20	93,000.00	576,600.00
2020060400002865	002008	大族	2020-06-04	2020-07-02	35.95	14,000.00	503,300.00

		激光					
2020060400002867	002032	苏泊尔	2020-06-04	2020-07-02	71.00	10,000.00	710,000.00
2020060400002869	002230	科大讯飞	2020-06-04	2020-07-02	37.43	11,000.00	411,730.00
2020060400002875	002673	西部证券	2020-06-04	2020-07-02	8.16	50,000.00	408,000.00
2020060400002879	000876	新希望	2020-06-04	2020-07-02	29.80	34,000.00	1,013,200.00
2020060400002899	002466	天齐锂业	2020-06-04	2020-07-02	22.95	10,000.00	229,500.00
2020060400002901	000723	美锦能源	2020-06-04	2020-07-02	6.26	30,000.00	187,800.00
2020060400002917	000723	美锦能源	2020-06-04	2020-07-02	6.26	10,000.00	62,600.00
2020060400002921	002939	长城证券	2020-06-04	2020-07-02	12.32	60,000.00	739,200.00
2020060900000251	000066	中国长城	2020-06-09	2020-07-07	13.20	30,000.00	396,000.00
2020060900000259	000066	中国长城	2020-06-09	2020-07-07	13.20	30,000.00	396,000.00
2020060900000260	000100	TCL 科技	2020-06-09	2020-07-07	6.20	140,000.00	868,000.00
2020060900000272	000596	古	2020-06-09	2020-07-07	150.24	10,000.00	1,502,400.00

		井贡酒					
2020060900000277	000661	长春高新	2020-06-09	2020-07-07	435.30	10,000.00	4,353,000.00
2020060900000279	000725	京东方 A	2020-06-09	2020-07-07	4.67	10,000.00	46,700.00
2020060900000283	000725	京东方 A	2020-06-09	2020-07-07	4.67	100,000.00	467,000.00
2020060900000314	000938	紫光股份	2020-06-09	2020-07-07	42.98	18,000.00	773,640.00
2020060900000387	002466	天齐锂业	2020-06-09	2020-07-07	22.95	15,000.00	344,250.00
2020060900000390	002466	天齐锂业	2020-06-09	2020-07-07	22.95	15,000.00	344,250.00
2020060900000409	002714	牧原股份	2020-06-09	2020-07-07	82.00	20,000.00	1,640,000.00
2020060900000417	002939	长城证券	2020-06-09	2020-07-07	12.32	65,000.00	800,800.00
2020060900000495	300628	亿联网络	2020-06-09	2020-07-07	68.26	15,000.00	1,023,900.00
2020060900001345	002466	天齐锂业	2020-06-09	2020-07-07	22.95	30,000.00	688,500.00
2020060900001391	300015	爱	2020-06-09	2020-07-07	43.45	10,000.00	434,500.00

		尔眼科					
2020060900001393	000063	中兴通讯	2020-06-09	2020-07-07	40.13	30,000.00	1,203,900.00
2020060900001481	002916	深南电路	2020-06-09	2020-07-07	167.52	40,000.00	6,700,800.00
2020060900002601	000876	新希望	2020-06-09	2020-07-07	29.80	37,000.00	1,102,600.00
2020060900003783	000723	美锦能源	2020-06-09	2020-07-07	6.26	10,000.00	62,600.00
2020060900004843	000938	紫光股份	2020-06-09	2020-07-07	42.98	15,000.00	644,700.00
2020060900004845	300015	爱尔眼科	2020-06-09	2020-07-07	43.45	170,000.00	7,386,500.00
2020060900005203	002410	广联达	2020-06-09	2020-07-07	69.70	15,000.00	1,045,500.00
2020061100000123	000661	长春高新	2020-06-11	2020-07-09	435.30	10,000.00	4,353,000.00
2020061100000140	000725	京东方 A	2020-06-11	2020-07-09	4.67	50,000.00	233,500.00
2020061100000175	002129	中环股份	2020-06-11	2020-07-09	22.46	60,000.00	1,347,600.00
2020061100000179	002129	中环股	2020-06-11	2020-07-09	22.46	10,000.00	224,600.00

		份					
2020061100000202	002352	顺丰控股	2020-06-11	2020-07-09	54.70	15,000.00	820,500.00
2020061100000208	002371	北方华创	2020-06-11	2020-07-09	170.91	10,000.00	1,709,100.00
2020061100001032	002466	天齐锂业	2020-06-11	2020-07-09	22.95	20,000.00	459,000.00
2020061100001034	002466	天齐锂业	2020-06-11	2020-07-09	22.95	40,000.00	918,000.00
2020061100001036	300059	东方财富	2020-06-11	2020-07-09	20.20	50,000.00	1,010,000.00
2020061100001038	300433	蓝思科技	2020-06-11	2020-07-09	28.04	20,000.00	560,800.00
2020061100001630	002352	顺丰控股	2020-06-11	2020-07-09	54.70	25,000.00	1,367,500.00
2020061100002088	002460	赣锋锂业	2020-06-11	2020-07-09	53.57	10,000.00	535,700.00
2020061100003786	002460	赣锋锂业	2020-06-11	2020-07-09	53.57	40,000.00	2,142,800.00
2020061100004394	000876	新希望	2020-06-11	2020-07-09	29.80	35,000.00	1,043,000.00
2020061600000258	000066	中国长城	2020-06-16	2020-07-14	13.20	80,000.00	1,056,000.00

2020061600000259	000066	中国长城	2020-06-16	2020-07-14	13.20	80,000.00	1,056,000.00
2020061600000262	000066	中国长城	2020-06-16	2020-07-14	13.20	60,000.00	792,000.00
2020061600000290	000100	TCL 科技	2020-06-16	2020-07-14	6.20	229,100.00	1,420,420.00
2020061600000440	000625	长安汽车	2020-06-16	2020-07-14	11.00	10,000.00	110,000.00
2020061600001295	002044	美年健康	2020-06-16	2020-07-14	14.41	10,000.00	144,100.00
2020061600001491	002120	韵达股份	2020-06-16	2020-07-14	24.45	20,000.00	489,000.00
2020061600001541	002129	中环股份	2020-06-16	2020-07-14	22.46	40,000.00	898,400.00
2020061600001546	002129	中环股份	2020-06-16	2020-07-14	22.46	20,000.00	449,200.00
2020061600002406	002352	顺丰控股	2020-06-16	2020-07-14	54.70	60,000.00	3,282,000.00
2020061600002410	002352	顺丰控股	2020-06-16	2020-07-14	54.70	30,000.00	1,641,000.00
2020061600002414	002352	顺丰控股	2020-06-16	2020-07-14	54.70	40,000.00	2,188,000.00
2020061600002417	002352	顺	2020-06-16	2020-07-14	54.70	50,000.00	2,735,000.00

		丰控股					
2020061600002422	002352	顺丰控股	2020-06-16	2020-07-14	54.70	180,000.00	9,846,000.00
2020061600002425	002352	顺丰控股	2020-06-16	2020-07-14	54.70	10,000.00	547,000.00
2020061600002874	002460	赣锋锂业	2020-06-16	2020-07-14	53.57	10,000.00	535,700.00
2020061600003052	002714	牧原股份	2020-06-16	2020-07-14	82.00	14,000.00	1,148,000.00
2020061600003192	300059	东方财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	60,000.00	1,212,000.00
2020061600003193	300059	东方财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	200,000.00	4,040,000.00
2020061600003206	300059	东方财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	1,000,000.00	20,200,000.00
2020061600003207	300059	东方财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	100,000.00	2,020,000.00
2020061600003208	300059	东方财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	100,000.00	2,020,000.00
2020061600007576	002230	科大讯飞	2020-06-16	2020-07-14	37.43	10,000.00	374,300.00
2020061600007642	002555	三	2020-06-16	2020-07-14	46.80	10,000.00	468,000.00

		七互娱					
2020061600007644	002475	立讯精密	2020-06-16	2020-07-14	51.35	18,400.00	944,840.00
2020061600007646	002001	新和成	2020-06-16	2020-07-14	29.10	20,000.00	582,000.00
2020061600007650	002555	三七互娱	2020-06-16	2020-07-14	46.80	20,000.00	936,000.00
2020061600007656	300059	东方财富	2020-06-16	2020-07-14	20.20	20,000.00	404,000.00
2020061600008170	002466	天齐锂业	2020-06-16	2020-07-14	22.95	41,000.00	940,950.00
2020061600008172	300033	同花顺	2020-06-16	2020-07-14	133.08	20,000.00	2,661,600.00
2020061600008426	002475	立讯精密	2020-06-16	2020-07-14	51.35	5,519.00	283,400.65
2020061700000357	000001	平安银行	2020-06-17	2020-07-15	12.80	137,100.00	1,754,880.00
2020061700000362	000002	万科 A	2020-06-17	2020-07-15	26.14	96,200.00	2,514,668.00
2020061700000509	000063	中兴通讯	2020-06-17	2020-07-15	40.13	37,700.00	1,512,901.00
2020061700000515	000066	中国长城	2020-06-17	2020-07-15	13.20	24,700.00	326,040.00

2020061700000517	000069	华侨城 A	2020-06-17	2020-07-15	6.06	57,800.00	350,268.00
2020061700000550	000100	TCL 科技	2020-06-17	2020-07-15	6.20	191,700.00	1,188,540.00
2020061700000567	000157	中联重科	2020-06-17	2020-07-15	6.43	73,400.00	471,962.00
2020061700000578	000166	申万宏源	2020-06-17	2020-07-15	5.05	127,400.00	643,370.00
2020061700000592	000333	美的集团	2020-06-17	2020-07-15	59.79	68,900.00	4,119,531.00
2020061700000594	000338	潍柴动力	2020-06-17	2020-07-15	13.72	67,600.00	927,472.00
2020061700000642	000425	徐工机械	2020-06-17	2020-07-15	5.91	66,300.00	391,833.00
2020061700000713	000538	云南白药	2020-06-17	2020-07-15	93.81	10,000.00	938,100.00
2020061700000752	000568	泸州老窖	2020-06-17	2020-07-15	91.12	10,000.00	911,200.00
2020061700000773	000596	古井贡酒	2020-06-17	2020-07-15	150.24	10,000.00	1,502,400.00
2020061700000803	000627	天茂集团	2020-06-17	2020-07-15	5.21	27,900.00	145,359.00
2020061700000815	000625	长	2020-06-17	2020-07-15	11.00	27,300.00	300,300.00

		安汽车					
2020061700000841	000661	长春高新	2020-06-17	2020-07-15	435.30	10,000.00	4,353,000.00
2020061700000842	000671	阳光城	2020-06-17	2020-07-15	6.34	22,700.00	143,918.00
2020061700000843	000651	格力电器	2020-06-17	2020-07-15	56.57	68,200.00	3,858,074.00
2020061700000844	000656	金科股份	2020-06-17	2020-07-15	8.16	29,900.00	243,984.00
2020061700000890	000703	恒逸石化	2020-06-17	2020-07-15	9.13	26,000.00	237,380.00
2020061700000894	000709	河钢股份	2020-06-17	2020-07-15	2.04	59,800.00	121,992.00
2020061700000895	000708	中信特钢	2020-06-17	2020-07-15	17.09	10,000.00	170,900.00
2020061700000925	000725	京东方 A	2020-06-17	2020-07-15	4.67	384,100.00	1,793,747.00
2020061700000928	000728	国元证券	2020-06-17	2020-07-15	8.40	28,600.00	240,240.00
2020061700000929	000723	美锦能源	2020-06-17	2020-07-15	6.26	16,900.00	105,794.00
2020061700000995	000768	中航	2020-06-17	2020-07-15	17.74	19,500.00	345,930.00

		飞机					
2020061700000998	000776	广发证券	2020-06-17	2020-07-15	14.12	41,600.00	587,392.00
2020061700001008	000783	长江证券	2020-06-17	2020-07-15	6.74	54,600.00	368,004.00
2020061700001019	000786	北新建材	2020-06-17	2020-07-15	21.33	11,700.00	249,561.00
2020061700001115	000860	顺鑫农业	2020-06-17	2020-07-15	56.98	10,000.00	569,800.00
2020061700001116	000858	五粮液	2020-06-17	2020-07-15	171.12	27,300.00	4,671,576.00
2020061700001329	000895	双汇发展	2020-06-17	2020-07-15	46.09	13,600.00	626,824.00
2020061700001691	000938	紫光股份	2020-06-17	2020-07-15	42.98	14,300.00	614,614.00
2020061700001739	000963	华东医药	2020-06-17	2020-07-15	25.30	12,300.00	311,190.00
2020061700001742	000961	中南建设	2020-06-17	2020-07-15	8.90	26,000.00	231,400.00
2020061700001851	000977	浪潮信息	2020-06-17	2020-07-15	39.18	14,300.00	560,274.00
2020061700002135	001979	招商蛇口	2020-06-17	2020-07-15	16.44	44,800.00	736,512.00

		口					
2020061700002137	002001	新和成	2020-06-17	2020-07-15	29.10	18,200.00	529,620.00
2020061700002216	002008	大族激光	2020-06-17	2020-07-15	35.95	11,700.00	420,615.00
2020061700002220	002007	华兰生物	2020-06-17	2020-07-15	50.11	14,900.00	746,639.00
2020061700002314	002024	苏宁易购	2020-06-17	2020-07-15	8.77	52,600.00	461,302.00
2020061700002318	002027	分众传媒	2020-06-17	2020-07-15	5.57	145,600.00	810,992.00
2020061700002605	002032	苏泊尔	2020-06-17	2020-07-15	71.00	10,000.00	710,000.00
2020061700002649	002044	美年健康	2020-06-17	2020-07-15	14.41	38,300.00	551,903.00
2020061700002670	002050	三花智控	2020-06-17	2020-07-15	21.90	25,300.00	554,070.00
2020061700003069	002120	韵达股份	2020-06-17	2020-07-15	24.45	16,200.00	396,090.00
2020061700003156	002129	中环股份	2020-06-17	2020-07-15	22.46	27,300.00	613,158.00
2020061700003549	002142	宁波银行	2020-06-17	2020-07-15	26.27	42,200.00	1,108,594.00
2020061700003552	002146	荣	2020-06-17	2020-07-15	8.10	24,000.00	194,400.00

		盛发展					
2020061700003571	002153	石基信息	2020-06-17	2020-07-15	39.03	10,000.00	390,300.00
2020061700003605	002157	正邦科技	2020-06-17	2020-07-15	17.48	17,500.00	305,900.00
2020061700003734	002179	中航光电	2020-06-17	2020-07-15	41.01	10,000.00	410,100.00
2020061700003851	002202	金风科技	2020-06-17	2020-07-15	9.97	39,000.00	388,830.00
2020061700004009	002230	科大讯飞	2020-06-17	2020-07-15	37.43	21,400.00	801,002.00
2020061700004048	002241	歌尔股份	2020-06-17	2020-07-15	29.36	31,800.00	933,648.00
2020061700004057	002236	大华股份	2020-06-17	2020-07-15	19.21	25,300.00	486,013.00
2020061700004143	002252	上海莱士	2020-06-17	2020-07-15	8.46	28,600.00	241,956.00
2020061700004495	002271	东方雨虹	2020-06-17	2020-07-15	40.63	14,900.00	605,387.00
2020061700004596	002311	海大集团	2020-06-17	2020-07-15	47.59	11,000.00	523,490.00
2020061700004603	002304	洋	2020-06-17	2020-07-15	105.14	10,000.00	1,051,400.00

		河股份					
2020061700004688	002352	顺丰控股	2020-06-17	2020-07-15	54.70	18,200.00	995,540.00
2020061700004727	002371	北方华创	2020-06-17	2020-07-15	170.91	10,000.00	1,709,100.00
2020061700004970	002410	广联达	2020-06-17	2020-07-15	69.70	12,300.00	857,310.00
2020061700004984	002415	海康威视	2020-06-17	2020-07-15	30.35	52,600.00	1,596,410.00
2020061700005009	002422	科伦药业	2020-06-17	2020-07-15	21.00	14,300.00	300,300.00
2020061700005076	002456	欧菲光	2020-06-17	2020-07-15	18.39	26,600.00	489,174.00
2020061700005095	002463	沪电股份	2020-06-17	2020-07-15	24.98	16,900.00	422,162.00
2020061700005098	002460	赣锋锂业	2020-06-17	2020-07-15	53.57	10,400.00	557,128.00
2020061700005111	002466	天齐锂业	2020-06-17	2020-07-15	22.95	12,300.00	282,285.00
2020061700005113	002468	申通快递	2020-06-17	2020-07-15	16.41	10,000.00	164,100.00
2020061700005124	002475	立讯精	2020-06-17	2020-07-15	51.35	45,500.00	2,336,425.00

		密					
2020061700005137	002493	荣盛石化	2020-06-17	2020-07-15	12.30	26,600.00	327,180.00
2020061700005182	002508	老板电器	2020-06-17	2020-07-15	31.11	10,000.00	311,100.00
2020061700005206	002555	三七互娱	2020-06-17	2020-07-15	46.80	17,500.00	819,000.00
2020061700005213	002558	巨人网络	2020-06-17	2020-07-15	17.40	10,000.00	174,000.00
2020061700005266	002594	比亚迪	2020-06-17	2020-07-15	71.80	12,300.00	883,140.00
2020061700005273	002601	龙蟒佰利	2020-06-17	2020-07-15	18.50	14,300.00	264,550.00
2020061700005282	002602	世纪华通	2020-06-17	2020-07-15	15.31	35,100.00	537,381.00
2020061700005292	002624	完美世界	2020-06-17	2020-07-15	57.64	10,000.00	576,400.00
2020061700005296	002607	中公教育	2020-06-17	2020-07-15	27.75	10,000.00	277,500.00
2020061700005362	002673	西部证券	2020-06-17	2020-07-15	8.16	24,700.00	201,552.00
2020061700005400	002714	牧原股份	2020-06-17	2020-07-15	82.00	20,800.00	1,705,600.00

2020061700005402	002736	国信证券	2020-06-17	2020-07-15	11.30	34,400.00	388,720.00
2020061700005403	002739	万达电影	2020-06-17	2020-07-15	15.27	11,700.00	178,659.00
2020061700005418	002773	康弘药业	2020-06-17	2020-07-15	49.60	10,000.00	496,000.00
2020061700005475	002939	长城证券	2020-06-17	2020-07-15	12.32	13,000.00	160,160.00
2020061700005476	002958	青农商行	2020-06-17	2020-07-15	4.43	39,000.00	172,770.00
2020061700005509	300003	乐普医疗	2020-06-17	2020-07-15	36.52	17,500.00	639,100.00
2020061700005558	300014	亿纬锂能	2020-06-17	2020-07-15	47.85	13,000.00	622,050.00
2020061700005562	300015	爱尔眼科	2020-06-17	2020-07-15	43.45	27,900.00	1,212,255.00
2020061700005609	300033	同花顺	2020-06-17	2020-07-15	133.08	10,000.00	1,330,800.00
2020061700005620	300059	东方财富	2020-06-17	2020-07-15	20.20	91,000.00	1,838,200.00
2020061700005725	300122	智飞生物	2020-06-17	2020-07-15	100.15	10,000.00	1,001,500.00
2020061700005732	300124	汇	2020-06-17	2020-07-15	37.99	14,300.00	543,257.00

		川技术					
2020061700005759	300136	信维通信	2020-06-17	2020-07-15	53.02	10,400.00	551,408.00
2020061700005761	300142	沃森生物	2020-06-17	2020-07-15	52.36	21,400.00	1,120,504.00
2020061700005764	300144	宋城演艺	2020-06-17	2020-07-15	17.30	22,100.00	382,330.00
2020061700006027	300347	泰格医药	2020-06-17	2020-07-15	101.88	10,000.00	1,018,800.00
2020061700006044	300413	芒果超媒	2020-06-17	2020-07-15	65.20	10,000.00	652,000.00
2020061700006045	300408	三环集团	2020-06-17	2020-07-15	27.70	14,300.00	396,110.00
2020061700006067	300433	蓝思科技	2020-06-17	2020-07-15	28.04	18,200.00	510,328.00
2020061700006135	300498	温氏股份	2020-06-17	2020-07-15	21.80	63,000.00	1,373,400.00
2020061700006172	300601	康泰生物	2020-06-17	2020-07-15	162.16	10,000.00	1,621,600.00
2020061700006192	300628	亿联网络	2020-06-17	2020-07-15	68.26	10,000.00	682,600.00
2020061700012331	002241	歌	2020-06-17	2020-07-15	29.36	25,000.00	734,000.00

		尔股份					
2020061700012355	300142	沃森生物	2020-06-17	2020-07-01	52.36	14,000.00	733,040.00
2020061700012359	000100	TCL 科技	2020-06-17	2020-07-01	6.20	169,000.00	1,047,800.00
2020061700012361	002252	上海莱士	2020-06-17	2020-07-15	8.46	50,000.00	423,000.00
2020061700012367	002241	歌尔股份	2020-06-17	2020-07-15	29.36	10,000.00	293,600.00
2020061700012369	000100	TCL 科技	2020-06-17	2020-07-15	6.20	98,000.00	607,600.00
2020061700012483	000651	格力电器	2020-06-17	2020-07-01	56.57	13,000.00	735,410.00
2020061700012485	002027	分众传媒	2020-06-17	2020-07-01	5.57	139,000.00	774,230.00
2020061700012491	000063	中兴通讯	2020-06-17	2020-07-15	40.13	20,000.00	802,600.00
2020061800002362	300433	蓝思科技	2020-06-18	2020-07-02	28.04	58,300.00	1,634,732.00
2020061800002364	000876	新希望	2020-06-18	2020-07-16	29.80	60,000.00	1,788,000.00
2020061800002366	000876	新希望	2020-06-18	2020-07-16	29.80	80,000.00	2,384,000.00
2020061800002972	000100	TCL	2020-06-18	2020-07-02	6.20	50,000.00	310,000.00

		科技					
2020061800002976	002142	宁波银行	2020-06-18	2020-07-16	26.27	21,000.00	551,670.00
2020061800000150	000425	徐工机械	2020-06-18	2020-07-02	5.91	19,100.00	112,881.00
2020061800000189	000768	中航飞机	2020-06-18	2020-07-02	17.74	10,000.00	177,400.00
2020061800000198	000860	顺鑫农业	2020-06-18	2020-07-02	56.98	20,000.00	1,139,600.00
2020061800000201	000895	双汇发展	2020-06-18	2020-07-02	46.09	25,000.00	1,152,250.00
2020061800000208	000963	华东医药	2020-06-18	2020-07-02	25.30	24,300.00	614,790.00
2020061800000232	002007	华兰生物	2020-06-18	2020-07-16	50.11	10,000.00	501,100.00
2020061800000269	002129	中环股份	2020-06-18	2020-07-02	22.46	46,000.00	1,033,160.00
2020061800000270	002129	中环股份	2020-06-18	2020-07-16	22.46	10,000.00	224,600.00
2020061800000286	002153	石基信息	2020-06-18	2020-07-02	39.03	27,300.00	1,065,519.00
2020061800000295	002157	正邦	2020-06-18	2020-07-02	17.48	35,000.00	611,800.00

		科技					
2020061800000332	002352	顺丰控股	2020-06-18	2020-07-02	54.70	10,000.00	547,000.00
2020061800000339	002371	北方华创	2020-06-18	2020-07-02	170.91	20,000.00	3,418,200.00
2020061800000371	002475	立讯精密	2020-06-18	2020-07-16	51.35	11,700.00	600,795.00
2020061800000387	002594	比亚迪	2020-06-18	2020-07-02	71.80	16,200.00	1,163,160.00
2020061800000392	002607	中公教育	2020-06-18	2020-07-02	27.75	30,000.00	832,500.00
2020061800000407	002714	牧原股份	2020-06-18	2020-07-02	82.00	10,000.00	820,000.00
2020061800000416	002739	万达电影	2020-06-18	2020-07-02	15.27	32,000.00	488,640.00
2020061800000424	002739	万达电影	2020-06-18	2020-07-02	15.27	134,400.00	2,052,288.00
2020061800000437	300014	亿纬锂能	2020-06-18	2020-07-02	47.85	23,900.00	1,143,615.00
2020061800000455	300033	同花顺	2020-06-18	2020-07-16	133.08	10,000.00	1,330,800.00
2020061800000456	300059	东方财富	2020-06-18	2020-07-16	20.20	20,000.00	404,000.00

2020061800000462	300033	同花顺	2020-06-18	2020-07-02	133.08	10,000.00	1,330,800.00
2020061800000489	300142	沃森生物	2020-06-18	2020-07-02	52.36	19,400.00	1,015,784.00
2020061800000528	300433	蓝思科技	2020-06-18	2020-07-02	28.04	28,000.00	785,120.00
2020062300000254	002008	大族激光	2020-06-23	2020-07-21	35.95	29,200.00	1,049,740.00
2020062300000256	002007	华兰生物	2020-06-23	2020-07-21	50.11	150,000.00	7,516,500.00
2020062300000273	002129	中环股份	2020-06-23	2020-07-21	22.46	76,600.00	1,720,436.00
2020062300000275	002129	中环股份	2020-06-23	2020-07-21	22.46	10,000.00	224,600.00
2020062300000295	002352	顺丰控股	2020-06-23	2020-07-21	54.70	65,000.00	3,555,500.00
2020062300000307	002371	北方华创	2020-06-23	2020-07-21	170.91	15,000.00	2,563,650.00
2020062300000311	002594	比亚迪	2020-06-23	2020-07-07	71.80	20,000.00	1,436,000.00
2020062300000314	002602	世纪华通	2020-06-23	2020-07-07	15.31	30,000.00	459,300.00
2020062300000317	002714	牧原	2020-06-23	2020-07-21	82.00	13,300.00	1,090,600.00

		股份					
2020062300000332	002939	长城证券	2020-06-23	2020-07-21	12.32	46,000.00	566,720.00
2020062300000388	300059	东方财富	2020-06-23	2020-07-07	20.20	50,000.00	1,010,000.00
2020062300000390	300059	东方财富	2020-06-23	2020-07-07	20.20	60,000.00	1,212,000.00
2020062300000392	300059	东方财富	2020-06-23	2020-07-21	20.20	10,000.00	202,000.00
2020062300000393	300059	东方财富	2020-06-23	2020-07-21	20.20	300,000.00	6,060,000.00
2020062300000395	300059	东方财富	2020-06-23	2020-07-21	20.20	60,000.00	1,212,000.00
2020062300000400	300059	东方财富	2020-06-23	2020-07-07	20.20	100,000.00	2,020,000.00
2020062300000507	300413	芒果超媒	2020-06-23	2020-07-21	65.20	15,300.00	997,560.00
2020062300000510	300433	蓝思科技	2020-06-23	2020-07-21	28.04	40,000.00	1,121,600.00
2020062300001614	000066	中国长城	2020-06-23	2020-07-07	13.20	30,000.00	396,000.00
2020062300001618	002594	比亚迪	2020-06-23	2020-07-07	71.80	20,000.00	1,436,000.00

		迪					
2020062300001624	000723	美锦能源	2020-06-23	2020-07-07	6.26	20,000.00	125,200.00
2020062300001632	002230	科大讯飞	2020-06-23	2020-07-07	37.43	24,300.00	909,549.00
2020062300001658	000100	TCL 科技	2020-06-23	2020-07-07	6.20	100,000.00	620,000.00
2020062300001730	002714	牧原股份	2020-06-23	2020-07-21	82.00	10,000.00	820,000.00
2020062300001738	002916	深南电路	2020-06-23	2020-07-07	167.52	30,000.00	5,025,600.00
2020062300001764	002466	天齐锂业	2020-06-23	2020-07-07	22.95	30,000.00	688,500.00
2020062300001766	000876	新希望	2020-06-23	2020-07-07	29.80	300,000.00	8,940,000.00
2020062400006375	002241	歌尔股份	2020-06-24	2020-07-08	29.36	25,000.00	734,000.00
2020062400006809	000063	中兴通讯	2020-06-24	2020-07-22	40.13	130,000.00	5,216,900.00
2020062900000502	002466	天齐锂业	2020-06-29	2020-07-27	22.95	20,000.00	459,000.00
2020062900002552	000723	美锦能源	2020-06-29	2020-07-27	6.26	10,000.00	62,600.00
2020062900002776	002460	赣	2020-06-29	2020-07-27	53.57	14,000.00	749,980.00

		锋 锂 业					
2020062900002780	000876	新 希 望	2020-06-29	2020-07-27	29.80	100,000.00	2,980,000.00
2020062900002796	000858	五 粮 液	2020-06-29	2020-07-27	171.12	10,000.00	1,711,200.00
2020062900002798	000333	美 的 集 团	2020-06-29	2020-07-27	59.79	10,000.00	597,900.00
2020062900002800	000538	云 南 白 药	2020-06-29	2020-07-27	93.81	10,000.00	938,100.00
2020062900002802	002352	顺 丰 控 股	2020-06-29	2020-07-27	54.70	10,000.00	547,000.00
2020062900003412	002371	北 方 华 创	2020-06-29	2020-07-13	170.91	10,000.00	1,709,100.00
2020062900003436	000895	双 汇 发 展	2020-06-29	2020-07-27	46.09	10,000.00	460,900.00
2020062900003440	000651	格 力 电 器	2020-06-29	2020-07-27	56.57	10,000.00	565,700.00
2020062900003448	002739	万 达 电 影	2020-06-29	2020-07-27	15.27	10,000.00	152,700.00
2020062900003596	000723	美 锦 能 源	2020-06-29	2020-07-13	6.26	20,000.00	125,200.00
2020062900003598	300144	宋 城 演	2020-06-29	2020-07-27	17.30	10,000.00	173,000.00

		艺					
2020062900003600	002466	天齐锂业	2020-06-29	2020-07-27	22.95	11,200.00	257,040.00
2020062900003602	002475	立讯精密	2020-06-29	2020-07-13	51.35	10,000.00	513,500.00
2020062900003668	002466	天齐锂业	2020-06-29	2020-07-27	22.95	10,000.00	229,500.00
2020062900003696	000876	新希望	2020-06-29	2020-07-27	29.80	35,000.00	1,043,000.00
2020062900003698	000723	美锦能源	2020-06-29	2020-07-27	6.26	58,000.00	363,080.00
2020062900003774	002352	顺丰控股	2020-06-29	2020-07-13	54.70	15,000.00	820,500.00
2020062900004198	300015	爱尔眼科	2020-06-29	2020-07-13	43.45	20,000.00	869,000.00
2020062900004200	000661	长春高新	2020-06-29	2020-07-13	435.30	18,000.00	7,835,400.00
2020062900004202	300033	同花顺	2020-06-29	2020-07-13	133.08	10,000.00	1,330,800.00
2020063000007990	000651	格力电器	2020-06-30	2020-07-28	56.57	10,000.00	565,700.00
2020063000008030	002153	石基信息	2020-06-30	2020-07-28	39.03	13,000.00	507,390.00
2020063000008122	000725	京	2020-06-30	2020-07-28	4.67	189,000.00	882,630.00

		东方 A					
2020063000008190	000786	北新建材	2020-06-30	2020-07-14	21.33	46,400.00	989,712.00
2020063000008268	002739	万达电影	2020-06-30	2020-07-28	15.27	43,000.00	656,610.00
2020063000008280	000100	TCL 科技	2020-06-30	2020-07-14	6.20	50,000.00	310,000.00
2020063000008294	002939	长城证券	2020-06-30	2020-07-28	12.32	47,000.00	579,040.00
2020063000008396	300433	蓝思科技	2020-06-30	2020-07-28	28.04	30,000.00	841,200.00
2020063000008426	000100	TCL 科技	2020-06-30	2020-07-14	6.20	200,000.00	1,240,000.00
2020063000008450	002466	天齐锂业	2020-06-30	2020-07-14	22.95	20,000.00	459,000.00
2020063000008546	000876	新希望	2020-06-30	2020-07-14	29.80	25,000.00	745,000.00
2020063000008608	002460	赣锋锂业	2020-06-30	2020-07-14	53.57	25,200.00	1,349,964.00
2020063000008662	002466	天齐锂业	2020-06-30	2020-07-14	22.95	10,000.00	229,500.00
2020063000008714	300015	爱尔眼科	2020-06-30	2020-07-28	43.45	18,000.00	782,100.00

2020063000008772	000568	泸州老窖	2020-06-30	2020-07-28	91.12	10,000.00	911,200.00
2020063000008774	002032	苏泊尔	2020-06-30	2020-07-28	71.00	10,000.00	710,000.00
2020060300000977	601012	隆基股份	2020-06-03	2020-07-01	40.73	20,000.00	814,600.00
2020060300001793	600276	恒瑞医药	2020-06-03	2020-07-01	92.30	20,000.00	1,846,000.00
2020060400000603	600795	国电电力	2020-06-04	2020-07-02	1.85	400,000.00	740,000.00
2020060400000606	600516	方大炭素	2020-06-04	2020-07-02	6.28	20,000.00	125,600.00
2020060400000607	601688	华泰证券	2020-06-04	2020-07-02	18.80	10,000.00	188,000.00
2020060400000620	600196	复星医药	2020-06-04	2020-07-02	33.85	10,000.00	338,500.00
2020060400000629	600221	海航控股	2020-06-04	2020-07-02	1.50	1,000,000.00	1,500,000.00
2020060400000632	600221	海航控股	2020-06-04	2020-07-02	1.50	200,000.00	300,000.00
2020060400000634	600570	恒生电子	2020-06-04	2020-07-02	107.70	10,000.00	1,077,000.00
2020060400000635	600109	国	2020-06-04	2020-07-02	11.41	400,000.00	4,564,000.00

		金证券					
2020060400000693	601212	白银有色	2020-06-04	2020-07-02	2.55	158,000.00	402,900.00
2020060400000722	603799	华友钴业	2020-06-04	2020-07-02	38.86	60,000.00	2,331,600.00
2020060400000728	603799	华友钴业	2020-06-04	2020-07-02	38.86	37,000.00	1,437,820.00
2020060400000736	600048	保利地产	2020-06-04	2020-07-02	14.78	20,000.00	295,600.00
2020060400000744	600390	五矿资本	2020-06-04	2020-07-02	7.06	136,000.00	960,160.00
2020060400000773	600111	北方稀土	2020-06-04	2020-07-02	9.32	50,000.00	466,000.00
2020060400000780	600111	北方稀土	2020-06-04	2020-07-02	9.32	50,000.00	466,000.00
2020060400000803	600104	上汽集团	2020-06-04	2020-07-02	16.99	10,000.00	169,900.00
2020060400000817	600522	中天科技	2020-06-04	2020-07-02	11.45	200,000.00	2,290,000.00
2020060400000821	600522	中天科技	2020-06-04	2020-07-02	11.45	20,000.00	229,000.00
2020060400000849	603259	药	2020-06-04	2020-07-02	96.60	10,000.00	966,000.00

		明康德					
2020060400000855	600111	北方稀土	2020-06-04	2020-07-02	9.32	70,000.00	652,400.00
2020060400000888	600887	伊利股份	2020-06-04	2020-07-02	31.13	10,000.00	311,300.00
2020060400000900	600522	中天科技	2020-06-04	2020-07-02	11.45	150,000.00	1,717,500.00
2020060400000903	600221	海航控股	2020-06-04	2020-07-02	1.50	600,000.00	900,000.00
2020060400002111	601066	中信建投	2020-06-04	2020-07-02	39.38	80,000.00	3,150,400.00
2020060400002519	600118	中国卫星	2020-06-04	2020-07-02	30.83	27,000.00	832,410.00
2020060400002521	600482	中国动力	2020-06-04	2020-07-02	15.70	49,000.00	769,300.00
2020060400002525	603288	海天味业	2020-06-04	2020-07-02	124.40	10,000.00	1,244,000.00
2020060400002529	603019	中科曙光	2020-06-04	2020-07-02	38.40	10,000.00	384,000.00
2020060400002533	603799	华友钴业	2020-06-04	2020-07-02	38.86	25,400.00	987,044.00
2020060400002847	600660	福	2020-06-04	2020-07-02	20.87	21,000.00	438,270.00

		耀 玻 璃					
2020060400002849	600703	三 安 光 电	2020-06-04	2020-07-02	25.00	18,000.00	450,000.00
2020060400002851	600438	通 威 股 份	2020-06-04	2020-07-02	17.38	26,000.00	451,880.00
2020060400002853	600066	宇 通 客 车	2020-06-04	2020-07-02	12.20	32,000.00	390,400.00
2020060400002855	601238	广 汽 集 团	2020-06-04	2020-07-02	9.00	39,000.00	351,000.00
2020060400002857	601377	兴 业 证 券	2020-06-04	2020-07-02	6.85	66,000.00	452,100.00
2020060400002861	601901	方 正 证 券	2020-06-04	2020-07-02	7.08	57,000.00	403,560.00
2020060400002871	601633	长 城 汽 车	2020-06-04	2020-07-02	7.72	48,000.00	370,560.00
2020060400002873	600025	华 能 水 电	2020-06-04	2020-07-02	3.79	112,000.00	424,480.00
2020060400002877	601360	三 六 零	2020-06-04	2020-07-02	18.31	11,000.00	201,410.00
2020060400002893	600703	三 安 光 电	2020-06-04	2020-07-02	25.00	100,000.00	2,500,000.00
2020060400002903	600111	北 方	2020-06-04	2020-07-02	9.32	20,000.00	186,400.00

		稀 土					
2020060400002905	600516	方 大 炭 素	2020-06-04	2020-07-02	6.28	50,000.00	314,000.00
2020060400002915	600111	北 方 稀 土	2020-06-04	2020-07-02	9.32	40,000.00	372,800.00
2020060500007448	601727	上 海 电 气	2020-06-05	2020-07-03	5.04	1,000,000.00	5,040,000.00
2020060500007450	601727	上 海 电 气	2020-06-05	2020-07-03	5.04	1,000,000.00	5,040,000.00
2020060500009365	600570	恒 生 电 子	2020-06-05	2020-07-02	107.70	3,000.00	323,100.00
2020060900000527	600998	九 州 通	2020-06-09	2020-07-07	18.62	32,200.00	599,564.00
2020060900000529	600516	方 大 炭 素	2020-06-09	2020-07-07	6.28	10,000.00	62,800.00
2020060900000536	600221	海 航 控 股	2020-06-09	2020-07-07	1.50	200,000.00	300,000.00
2020060900000541	601066	中 信 建 投	2020-06-09	2020-07-07	39.38	30,000.00	1,181,400.00
2020060900000556	601162	天 风 证 券	2020-06-09	2020-07-07	6.06	40,000.00	242,400.00
2020060900000567	601162	天 风 证	2020-06-09	2020-07-07	6.06	50,000.00	303,000.00

		券 合 盛 硅 业					
2020060900000608	603260		2020-06-09	2020-07-07	27.34	10,000.00	273,400.00
2020060900000630	601088	中 国 神 华	2020-06-09	2020-07-07	14.36	10,000.00	143,600.00
2020060900000719	600522	中 天 科 技	2020-06-09	2020-07-07	11.45	50,000.00	572,500.00
2020060900001479	603019	中 科 曙 光	2020-06-09	2020-07-07	38.40	20,000.00	768,000.00
2020060900001573	600028	中 国 石 化	2020-06-09	2020-07-07	3.91	500,000.00	1,955,000.00
2020060900001665	600703	三 安 光 电	2020-06-09	2020-07-07	25.00	30,000.00	750,000.00
2020060900001715	601985	中 国 核 电	2020-06-09	2020-07-07	4.09	37,000.00	151,330.00
2020060900002457	601601	中 国 太 保	2020-06-09	2020-07-07	27.25	20,000.00	545,000.00
2020060900002553	600028	中 国 石 化	2020-06-09	2020-07-07	3.91	1,000,000.00	3,910,000.00
2020060900002689	603156	养 元 饮 品	2020-06-09	2020-07-07	21.50	22,000.00	473,000.00
2020060900003873	600570	恒 生 电	2020-06-09	2020-07-07	107.70	10,000.00	1,077,000.00

		子					
2020060900004315	600585	海螺水泥	2020-06-09	2020-07-07	52.91	400,000.00	21,164,000.00
2020060900004703	603019	中科曙光	2020-06-09	2020-07-07	38.40	12,000.00	460,800.00
2020060900004841	600585	海螺水泥	2020-06-09	2020-07-07	52.91	40,000.00	2,116,400.00
2020060900005103	600547	山东黄金	2020-06-09	2020-07-07	36.62	20,000.00	732,400.00
2020061100000349	600745	闻泰科技	2020-06-11	2020-07-09	125.95	30,000.00	3,778,500.00
2020061100000371	600487	亨通光电	2020-06-11	2020-07-09	16.41	79,300.00	1,301,313.00
2020061100000459	601012	隆基股份	2020-06-11	2020-07-09	40.73	10,000.00	407,300.00
2020061100001030	601162	天风证券	2020-06-11	2020-07-09	6.06	100,000.00	606,000.00
2020061100001040	601066	中信建投	2020-06-11	2020-07-09	39.38	35,000.00	1,378,300.00
2020061100001042	600703	三安光电	2020-06-11	2020-07-09	25.00	10,000.00	250,000.00
2020061100001044	603799	华友钴	2020-06-11	2020-07-09	38.86	80,000.00	3,108,800.00

		业					
2020061100001046	600118	中国卫星	2020-06-11	2020-07-09	30.83	140,000.00	4,316,200.00
2020061100002442	601066	中信建投	2020-06-11	2020-07-09	39.38	10,000.00	393,800.00
2020061100003792	601162	天风证券	2020-06-11	2020-07-09	6.06	200,000.00	1,212,000.00
2020061100004384	600516	方大炭素	2020-06-11	2020-07-09	6.28	20,000.00	125,600.00
2020061100004390	601066	中信建投	2020-06-11	2020-07-09	39.38	15,000.00	590,700.00
2020061600000812	600516	方大炭素	2020-06-16	2020-07-14	6.28	30,000.00	188,400.00
2020061600000829	600516	方大炭素	2020-06-16	2020-07-14	6.28	30,000.00	188,400.00
2020061600000836	600516	方大炭素	2020-06-16	2020-07-14	6.28	30,000.00	188,400.00
2020061600000938	600998	九州通	2020-06-16	2020-07-14	18.62	10,000.00	186,200.00
2020061600001004	600029	南方航空	2020-06-16	2020-07-14	5.17	10,000.00	51,700.00
2020061600001019	600221	海航控股	2020-06-16	2020-07-14	1.50	100,000.00	150,000.00

2020061600001070	603160	汇顶科技	2020-06-16	2020-07-14	222.90	10,000.00	2,229,000.00
2020061600001130	601162	天风证券	2020-06-16	2020-07-14	6.06	200,000.00	1,212,000.00
2020061600001240	600487	亨通光电	2020-06-16	2020-07-14	16.41	10,000.00	164,100.00
2020061600001920	600111	北方稀土	2020-06-16	2020-07-14	9.32	10,000.00	93,200.00
2020061600001950	603019	中科曙光	2020-06-16	2020-07-14	38.40	20,000.00	768,000.00
2020061600002628	600968	海油发展	2020-06-16	2020-07-14	2.33	800,000.00	1,864,000.00
2020061600007570	600498	烽火通信	2020-06-16	2020-07-14	28.91	180,000.00	5,203,800.00
2020061600007572	600703	三安光电	2020-06-16	2020-07-14	25.00	100,000.00	2,500,000.00
2020061600007574	603986	兆易创新	2020-06-16	2020-07-14	235.91	32,000.00	7,549,120.00
2020061600007578	603799	华友钴业	2020-06-16	2020-07-14	38.86	20,000.00	777,200.00
2020061600007580	601360	三六零	2020-06-16	2020-07-14	18.31	22,500.00	411,975.00
2020061600007648	600183	生	2020-06-16	2020-07-14	29.27	20,000.00	585,400.00

		益科技					
2020061600007652	600276	恒瑞医药	2020-06-16	2020-07-14	92.30	20,000.00	1,846,000.00
2020061600007654	600703	三安光电	2020-06-16	2020-07-14	25.00	10,000.00	250,000.00
2020061600007658	600588	用友网络	2020-06-16	2020-07-14	44.10	20,000.00	882,000.00
2020061600007660	603019	中科曙光	2020-06-16	2020-07-14	38.40	20,000.00	768,000.00
2020061600008070	601236	红塔证券	2020-06-16	2020-07-14	19.40	130,000.00	2,522,000.00
2020061600008174	603501	韦尔股份	2020-06-16	2020-07-14	201.95	17,000.00	3,433,150.00
2020061700001081	601985	中国核电	2020-06-17	2020-07-15	4.09	87,700.00	358,693.00
2020061700001091	601006	大秦铁路	2020-06-17	2020-07-15	7.04	83,800.00	589,952.00
2020061700001107	600118	中国卫星	2020-06-17	2020-07-15	30.83	10,000.00	308,300.00
2020061700001109	601766	中国中车	2020-06-17	2020-07-15	5.57	172,200.00	959,154.00
2020061700001126	600016	民生	2020-06-17	2020-07-15	5.67	301,600.00	1,710,072.00

		生 银 行					
2020061700001142	601628	中 国 人 寿	2020-06-17	2020-07-15	27.21	23,400.00	636,714.00
2020061700001144	600011	华 能 国 际	2020-06-17	2020-07-15	4.22	62,400.00	263,328.00
2020061700001159	601688	华 泰 证 券	2020-06-17	2020-07-15	18.80	83,200.00	1,564,160.00
2020061700001162	600406	国 电 南 瑞	2020-06-17	2020-07-15	20.25	32,500.00	658,125.00
2020061700001180	601288	农 业 银 行	2020-06-17	2020-07-15	3.38	407,500.00	1,377,350.00
2020061700001184	600795	国 电 电 力	2020-06-17	2020-07-15	1.85	167,000.00	308,950.00
2020061700001196	601229	上 海 银 行	2020-06-17	2020-07-15	8.30	141,000.00	1,170,300.00
2020061700001201	600196	复 星 医 药	2020-06-17	2020-07-15	33.85	16,900.00	572,065.00
2020061700001231	600066	宇 通 客 车	2020-06-17	2020-07-15	12.20	18,200.00	222,040.00
2020061700001235	601828	美 凯 龙	2020-06-17	2020-07-15	10.59	10,000.00	105,900.00
2020061700001243	600926	杭 州	2020-06-17	2020-07-15	8.92	33,100.00	295,252.00

		银行					
2020061700001258	601939	建设银行	2020-06-17	2020-07-15	6.31	94,900.00	598,819.00
2020061700001265	600362	江西铜业	2020-06-17	2020-07-15	13.46	14,300.00	192,478.00
2020061700001266	600038	中直股份	2020-06-17	2020-07-15	41.07	10,000.00	410,700.00
2020061700001297	600050	中国联通	2020-06-17	2020-07-15	4.84	131,900.00	638,396.00
2020061700001307	603993	洛阳钼业	2020-06-17	2020-07-15	3.67	100,100.00	367,367.00
2020061700001308	601899	紫金矿业	2020-06-17	2020-07-15	4.40	195,000.00	858,000.00
2020061700001333	601988	中国银行	2020-06-17	2020-07-15	3.48	299,000.00	1,040,520.00
2020061700001347	600998	九州通	2020-06-17	2020-07-15	18.62	10,400.00	193,648.00
2020061700001359	600516	方大炭素	2020-06-17	2020-07-15	6.28	31,800.00	199,704.00
2020061700001378	600745	闻泰科技	2020-06-17	2020-07-15	125.95	10,000.00	1,259,500.00
2020061700001409	600221	海航控	2020-06-17	2020-07-15	1.50	163,100.00	244,650.00

		股					
2020061700001427	600027	华电国际	2020-06-17	2020-07-15	3.42	46,100.00	157,662.00
2020061700001450	600570	恒生电子	2020-06-17	2020-07-15	107.70	11,700.00	1,260,090.00
2020061700001457	600089	特变电工	2020-06-17	2020-07-15	6.77	52,600.00	356,102.00
2020061700001477	600115	东方航空	2020-06-17	2020-07-15	4.22	63,000.00	265,860.00
2020061700001495	603288	海天味业	2020-06-17	2020-07-15	124.40	13,600.00	1,691,840.00
2020061700001507	603986	兆易创新	2020-06-17	2020-07-15	235.91	10,000.00	2,359,100.00
2020061700001514	600029	南方航空	2020-06-17	2020-07-15	5.17	60,400.00	312,268.00
2020061700001540	600588	用友网络	2020-06-17	2020-07-15	44.10	22,700.00	1,001,070.00
2020061700001551	600109	国金证券	2020-06-17	2020-07-15	11.41	33,800.00	385,658.00
2020061700001560	601018	宁波港	2020-06-17	2020-07-15	3.57	55,900.00	199,563.00
2020061700001577	600068	葛洲坝	2020-06-17	2020-07-15	5.95	39,000.00	232,050.00
2020061700001581	603160	汇	2020-06-17	2020-07-15	222.90	10,000.00	2,229,000.00

		顶科技					
2020061700001588	600219	南山铝业	2020-06-17	2020-07-15	2.03	101,400.00	205,842.00
2020061700001600	600004	白云机场	2020-06-17	2020-07-15	15.24	14,300.00	217,932.00
2020061700001719	600177	雅戈尔	2020-06-17	2020-07-15	5.96	39,000.00	232,440.00
2020061700001745	600031	三一重工	2020-06-17	2020-07-15	18.76	83,200.00	1,560,832.00
2020061700001760	600352	浙江龙盛	2020-06-17	2020-07-15	12.79	36,400.00	465,556.00
2020061700001779	601398	工商银行	2020-06-17	2020-07-15	4.98	497,200.00	2,476,056.00
2020061700001798	601162	天风证券	2020-06-17	2020-07-15	6.06	46,800.00	283,608.00
2020061700001802	601808	中海油服	2020-06-17	2020-07-15	13.14	10,000.00	131,400.00
2020061700001843	601800	中国交建	2020-06-17	2020-07-15	7.34	49,400.00	362,596.00
2020061700001861	601318	中国平安	2020-06-17	2020-07-15	71.40	153,400.00	10,952,760.00
2020061700001892	601607	上海	2020-06-17	2020-07-15	18.38	16,200.00	297,756.00

		医药					
2020061700001898	600018	上港集团	2020-06-17	2020-07-15	4.20	48,700.00	204,540.00
2020061700001914	600741	华域汽车	2020-06-17	2020-07-15	20.79	22,100.00	459,459.00
2020061700001920	600009	上海机场	2020-06-17	2020-07-15	72.07	13,600.00	980,152.00
2020061700001955	603501	韦尔股份	2020-06-17	2020-07-15	201.95	10,000.00	2,019,500.00
2020061700001981	601600	中国铝业	2020-06-17	2020-07-15	2.76	92,300.00	254,748.00
2020061700001995	601390	中国中铁	2020-06-17	2020-07-15	5.02	115,000.00	577,300.00
2020061700002018	601857	中国石油	2020-06-17	2020-07-15	4.19	137,800.00	577,382.00
2020061700002033	600299	安迪苏	2020-06-17	2020-07-15	12.22	10,000.00	122,200.00
2020061700002055	600900	长江电力	2020-06-17	2020-07-15	18.94	124,800.00	2,363,712.00
2020061700002068	600487	亨通光电	2020-06-17	2020-07-15	16.41	18,800.00	308,508.00
2020061700002096	601212	白银有	2020-06-17	2020-07-15	2.55	20,800.00	53,040.00

		色					
2020061700002105	600660	福耀玻璃	2020-06-17	2020-07-15	20.87	19,500.00	406,965.00
2020061700002131	601155	新城控股	2020-06-17	2020-07-15	31.24	12,300.00	384,252.00
2020061700002163	601100	恒立液压	2020-06-17	2020-07-15	80.20	10,000.00	802,000.00
2020061700002193	601668	中国建筑	2020-06-17	2020-07-15	4.77	297,700.00	1,420,029.00
2020061700002275	600061	国投资本	2020-06-17	2020-07-15	12.73	23,400.00	297,882.00
2020061700002302	600019	宝钢股份	2020-06-17	2020-07-15	4.56	126,100.00	575,016.00
2020061700002331	601138	工业富联	2020-06-17	2020-07-15	15.15	27,900.00	422,685.00
2020061700002355	603799	华友钴业	2020-06-17	2020-07-15	38.86	10,000.00	388,600.00
2020061700002389	601898	中煤能源	2020-06-17	2020-07-15	3.80	25,300.00	96,140.00
2020061700002406	601888	中国中免	2020-06-17	2020-07-15	154.03	13,600.00	2,094,808.00
2020061700002429	601838	成都银	2020-06-17	2020-07-15	7.96	30,500.00	242,780.00

		行					
2020061700002439	600674	川 投 能 源	2020-06-17	2020-07-15	9.27	18,200.00	168,714.00
2020061700002449	600489	中 金 黄 金	2020-06-17	2020-07-15	9.14	26,000.00	237,640.00
2020061700002456	600048	保 利 地 产	2020-06-17	2020-07-15	14.78	101,400.00	1,498,692.00
2020061700002464	603833	欧 派 家 居	2020-06-17	2020-07-15	115.90	10,000.00	1,159,000.00
2020061700002524	601919	中 远 海 控	2020-06-17	2020-07-15	3.47	68,200.00	236,654.00
2020061700002540	600188	兖 州 煤 业	2020-06-17	2020-07-15	8.76	12,300.00	107,748.00
2020061700002546	601998	中 信 银 行	2020-06-17	2020-07-15	5.15	42,900.00	220,935.00
2020061700002551	601989	中 国 重 工	2020-06-17	2020-07-15	4.00	129,300.00	517,200.00
2020061700002556	600010	包 钢 股 份	2020-06-17	2020-07-15	1.08	323,000.00	348,840.00
2020061700002569	600271	航 天 信 息	2020-06-17	2020-07-15	16.24	15,600.00	253,344.00
2020061700002576	601108	财 通 证	2020-06-17	2020-07-15	10.25	35,100.00	359,775.00

		券					
2020061700002582	603899	晨 光 文 具	2020-06-17	2020-07-15	54.60	10,000.00	546,000.00
2020061700002588	600332	白 云 山	2020-06-17	2020-07-15	32.33	10,000.00	323,300.00
2020061700002609	601231	环 旭 电 子	2020-06-17	2020-07-15	21.84	10,000.00	218,400.00
2020061700002621	600309	万 华 化 学	2020-06-17	2020-07-15	49.99	22,100.00	1,104,779.00
2020061700002648	601618	中 国 中 冶	2020-06-17	2020-07-15	2.51	100,700.00	252,757.00
2020061700002660	601166	兴 业 银 行	2020-06-17	2020-07-15	15.78	176,800.00	2,789,904.00
2020061700002679	603260	合 盛 硅 业	2020-06-17	2020-07-15	27.34	10,000.00	273,400.00
2020061700002700	601577	长 沙 银 行	2020-06-17	2020-07-15	7.94	14,300.00	113,542.00
2020061700002701	600390	五 矿 资 本	2020-06-17	2020-07-15	7.06	31,800.00	224,508.00
2020061700002733	601878	浙 商 证 券	2020-06-17	2020-07-15	9.91	18,800.00	186,308.00
2020061700002752	600383	金 地 集 团	2020-06-17	2020-07-15	13.70	31,800.00	435,660.00

2020061700002790	600340	华夏幸福	2020-06-17	2020-07-15	22.86	16,900.00	386,334.00
2020061700002856	600690	海尔智家	2020-06-17	2020-07-15	17.70	53,300.00	943,410.00
2020061700002886	600482	中国动力	2020-06-17	2020-07-15	15.70	10,000.00	157,000.00
2020061700002936	600372	中航电子	2020-06-17	2020-07-15	13.32	10,000.00	133,200.00
2020061700002971	600085	同仁堂	2020-06-17	2020-07-15	27.12	10,000.00	271,200.00
2020061700003002	600703	三安光电	2020-06-17	2020-07-15	25.00	34,400.00	860,000.00
2020061700003126	601298	青岛港	2020-06-17	2020-07-15	5.68	10,000.00	56,800.00
2020061700003152	601088	中国神华	2020-06-17	2020-07-15	14.36	46,800.00	672,048.00
2020061700003170	600919	江苏银行	2020-06-17	2020-07-15	5.67	130,600.00	740,502.00
2020061700003185	601021	春秋航空	2020-06-17	2020-07-15	35.24	10,000.00	352,400.00
2020061700003199	601336	新华保险	2020-06-17	2020-07-15	44.28	11,700.00	518,076.00
2020061700003216	600111	北方	2020-06-17	2020-07-15	9.32	30,500.00	284,260.00

		稀土					
2020061700003227	600867	通化东宝	2020-06-17	2020-07-15	17.43	20,100.00	350,343.00
2020061700003235	600655	豫园股份	2020-06-17	2020-07-15	8.86	21,400.00	189,604.00
2020061700003254	600886	国投电力	2020-06-17	2020-07-15	7.86	38,300.00	301,038.00
2020061700003277	601117	中国化学	2020-06-17	2020-07-15	5.48	34,400.00	188,512.00
2020061700003299	603019	中科曙光	2020-06-17	2020-07-15	38.40	14,300.00	549,120.00
2020061700003317	600015	华夏银行	2020-06-17	2020-07-15	6.12	87,100.00	533,052.00
2020061700003321	601009	南京银行	2020-06-17	2020-07-15	7.33	85,100.00	623,783.00
2020061700003416	600583	海油工程	2020-06-17	2020-07-15	4.55	31,200.00	141,960.00
2020061700003426	600176	中国巨石	2020-06-17	2020-07-15	9.15	29,200.00	267,180.00
2020061700003621	600398	海澜之家	2020-06-17	2020-07-15	5.82	18,200.00	105,924.00
2020061700003641	601012	隆基	2020-06-17	2020-07-15	40.73	37,000.00	1,507,010.00

		股份					
2020061700003645	600346	恒力石化	2020-06-17	2020-07-15	14.00	29,900.00	418,600.00
2020061700003662	601319	中国人保	2020-06-17	2020-07-15	6.44	29,900.00	192,556.00
2020061700003685	600498	烽火通信	2020-06-17	2020-07-15	28.91	10,000.00	289,100.00
2020061700003689	600977	中国电影	2020-06-17	2020-07-15	13.13	10,400.00	136,552.00
2020061700003697	601933	永辉超市	2020-06-17	2020-07-15	9.38	53,900.00	505,582.00
2020061700003717	600705	中航资本	2020-06-17	2020-07-15	3.96	76,000.00	300,960.00
2020061700003719	603658	安图生物	2020-06-17	2020-07-15	162.44	10,000.00	1,624,400.00
2020061700003733	600928	西安银行	2020-06-17	2020-07-15	5.26	18,800.00	98,888.00
2020061700003748	601901	方正证券	2020-06-17	2020-07-15	7.08	57,800.00	409,224.00
2020061700003765	601225	陕西煤业	2020-06-17	2020-07-15	7.21	56,500.00	407,365.00
2020061700003790	601997	贵阳	2020-06-17	2020-07-15	7.16	31,800.00	227,688.00

		银行					
2020061700003824	600208	新湖中宝	2020-06-17	2020-07-15	2.98	60,400.00	179,992.00
2020061700003859	600585	海螺水泥	2020-06-17	2020-07-15	52.91	33,800.00	1,788,358.00
2020061700003931	600170	上海建工	2020-06-17	2020-07-15	3.07	63,000.00	193,410.00
2020061700003964	600104	上汽集团	2020-06-17	2020-07-15	16.99	49,400.00	839,306.00
2020061700004018	601669	中国电建	2020-06-17	2020-07-15	3.46	108,500.00	375,410.00
2020061700004038	600519	贵州茅台	2020-06-17	2020-07-15	1,462.88	10,000.00	14,628,800.00
2020061700004058	603156	养元饮品	2020-06-17	2020-07-15	21.50	10,000.00	215,000.00
2020061700004072	601216	君正集团	2020-06-17	2020-07-15	2.54	47,400.00	120,396.00
2020061700004122	600893	航发动力	2020-06-17	2020-07-15	23.48	12,300.00	288,804.00
2020061700004136	601198	东兴证券	2020-06-17	2020-07-15	10.90	19,500.00	212,550.00
2020061700004160	600028	中国	2020-06-17	2020-07-15	3.91	189,800.00	742,118.00

		石化					
2020061700004161	600809	山西汾酒	2020-06-17	2020-07-15	145.00	10,000.00	1,450,000.00
2020061700004174	600522	中天科技	2020-06-17	2020-07-15	11.45	34,400.00	393,880.00
2020061700004177	600606	绿地控股	2020-06-17	2020-07-15	6.18	51,300.00	317,034.00
2020061700004191	601238	广汽集团	2020-06-17	2020-07-15	9.00	13,000.00	117,000.00
2020061700004231	600547	山东黄金	2020-06-17	2020-07-15	36.62	18,200.00	666,484.00
2020061700004247	600637	东方明珠	2020-06-17	2020-07-15	9.65	28,600.00	275,990.00
2020061700004258	601818	光大银行	2020-06-17	2020-07-15	3.58	225,500.00	807,290.00
2020061700004268	601377	兴业证券	2020-06-17	2020-07-15	6.85	66,300.00	454,155.00
2020061700004291	601186	中国铁建	2020-06-17	2020-07-15	8.38	65,000.00	544,700.00
2020061700004304	600000	浦发银行	2020-06-17	2020-07-15	10.58	166,400.00	1,760,512.00
2020061700004314	600276	恒瑞	2020-06-17	2020-07-15	92.30	52,600.00	4,854,980.00

		医药					
2020061700004324	601211	国泰君安	2020-06-17	2020-07-15	17.26	63,700.00	1,099,462.00
2020061700004329	600837	海通证券	2020-06-17	2020-07-15	12.58	114,400.00	1,439,152.00
2020061700004334	601111	中国国航	2020-06-17	2020-07-15	6.61	42,200.00	278,942.00
2020061700004338	600958	东方证券	2020-06-17	2020-07-15	9.49	50,700.00	481,143.00
2020061700004362	603369	今世缘	2020-06-17	2020-07-15	39.79	10,000.00	397,900.00
2020061700004374	600369	西南证券	2020-06-17	2020-07-15	4.59	39,600.00	181,764.00
2020061700004382	600036	招商银行	2020-06-17	2020-07-15	33.72	146,200.00	4,929,864.00
2020061700004389	601788	光大证券	2020-06-17	2020-07-15	16.06	27,300.00	438,438.00
2020061700004397	600233	圆通速递	2020-06-17	2020-07-15	14.56	17,500.00	254,800.00
2020061700004402	600760	中航沈飞	2020-06-17	2020-07-15	32.82	10,000.00	328,200.00
2020061700004409	601169	北京银	2020-06-17	2020-07-15	4.90	209,900.00	1,028,510.00

		行					
2020061700004413	600438	通威股份	2020-06-17	2020-07-15	17.38	36,400.00	632,632.00
2020061700004415	600968	海油发展	2020-06-17	2020-07-15	2.33	28,600.00	66,638.00
2020061700004418	600999	招商证券	2020-06-17	2020-07-15	21.95	40,300.00	884,585.00
2020061700004420	603259	药明康德	2020-06-17	2020-07-15	96.60	14,300.00	1,381,380.00
2020061700004429	601555	东吴证券	2020-06-17	2020-07-15	8.16	43,500.00	354,960.00
2020061700004437	600025	华能水电	2020-06-17	2020-07-15	3.79	25,300.00	95,887.00
2020061700004442	600297	广汇汽车	2020-06-17	2020-07-15	3.19	57,200.00	182,468.00
2020061700004447	601633	长城汽车	2020-06-17	2020-07-15	7.72	16,900.00	130,468.00
2020061700004464	600436	片仔癀	2020-06-17	2020-07-15	170.25	10,000.00	1,702,500.00
2020061700004539	600183	生益科技	2020-06-17	2020-07-15	29.27	15,600.00	456,612.00
2020061700004547	600887	伊利股份	2020-06-17	2020-07-15	31.13	85,800.00	2,670,954.00

2020061700004592	601328	交通银行	2020-06-17	2020-07-15	5.13	389,300.00	1,997,109.00
2020061700004622	601360	三六零	2020-06-17	2020-07-15	18.31	14,300.00	261,833.00
2020061700004648	601992	金隅集团	2020-06-17	2020-07-15	3.06	46,800.00	143,208.00
2020061700004670	601877	正泰电器	2020-06-17	2020-07-15	26.35	14,900.00	392,615.00
2020061700004701	600848	上海临港	2020-06-17	2020-07-15	21.47	10,000.00	214,700.00
2020061700004702	601881	中国银河	2020-06-17	2020-07-15	11.47	18,200.00	208,754.00
2020061700012327	600111	北方稀土	2020-06-17	2020-07-01	9.32	80,000.00	745,600.00
2020061700012357	600183	生益科技	2020-06-17	2020-07-01	29.27	60,000.00	1,756,200.00
2020061700012363	600660	福耀玻璃	2020-06-17	2020-07-01	20.87	36,000.00	751,320.00
2020061700012365	600893	航发动力	2020-06-17	2020-07-15	23.48	10,000.00	234,800.00
2020061700012385	600276	恒瑞医药	2020-06-17	2020-07-15	92.30	20,000.00	1,846,000.00
2020061700012389	600703	三	2020-06-17	2020-07-01	25.00	58,000.00	1,450,000.00

		安光电					
2020061700012487	600516	方大炭素	2020-06-17	2020-07-15	6.28	150,000.00	942,000.00
2020061700012489	600703	三安光电	2020-06-17	2020-07-15	25.00	60,000.00	1,500,000.00
2020061800000551	600516	方大炭素	2020-06-18	2020-07-16	6.28	10,000.00	62,800.00
2020061800000650	601100	恒立液压	2020-06-18	2020-07-02	80.20	20,000.00	1,604,000.00
2020061800000750	600438	通威股份	2020-06-18	2020-07-02	17.38	10,000.00	173,800.00
2020061800000769	600745	闻泰科技	2020-06-18	2020-07-02	125.95	20,000.00	2,519,000.00
2020061800000783	600221	海航控股	2020-06-18	2020-07-02	1.50	571,600.00	857,400.00
2020061800000796	600221	海航控股	2020-06-18	2020-07-02	1.50	81,500.00	122,250.00
2020061800000831	600498	烽火通信	2020-06-18	2020-07-16	28.91	23,800.00	688,058.00
2020061800000887	601212	白银有色	2020-06-18	2020-07-02	2.55	347,800.00	886,890.00
2020061800000914	603369	今	2020-06-18	2020-07-02	39.79	30,000.00	1,193,700.00

		世缘					
2020061800000978	600208	新湖中宝	2020-06-18	2020-07-02	2.98	299,100.00	891,318.00
2020061800000996	603993	洛阳钼业	2020-06-18	2020-07-02	3.67	60,000.00	220,200.00
2020061800001008	600848	上海临港	2020-06-18	2020-07-16	21.47	32,500.00	697,775.00
2020061800002546	600221	海航控股	2020-06-18	2020-07-02	1.50	550,000.00	825,000.00
2020061800002548	600795	国电电力	2020-06-18	2020-07-16	1.85	200,000.00	370,000.00
2020061800002574	600516	方大炭素	2020-06-18	2020-07-02	6.28	30,000.00	188,400.00
2020061800003148	600010	包钢股份	2020-06-18	2020-07-16	1.08	1,000,000.00	1,080,000.00
2020061800003150	600010	包钢股份	2020-06-18	2020-07-16	1.08	1,000,000.00	1,080,000.00
2020061800003152	600010	包钢股份	2020-06-18	2020-07-02	1.08	213,800.00	230,904.00
2020061800003154	600516	方大炭素	2020-06-18	2020-07-02	6.28	60,000.00	376,800.00
2020061800003156	603799	华友	2020-06-18	2020-07-02	38.86	10,000.00	388,600.00

		钴业					
2020061800003158	600010	包钢股份	2020-06-18	2020-07-16	1.08	1,000,000.00	1,080,000.00
2020061800003160	600010	包钢股份	2020-06-18	2020-07-16	1.08	1,000,000.00	1,080,000.00
2020061800003184	600516	方大炭素	2020-06-18	2020-07-16	6.28	20,000.00	125,600.00
2020061800003190	601878	浙商证券	2020-06-18	2020-07-16	9.91	50,000.00	495,500.00
2020061800003192	601012	隆基股份	2020-06-18	2020-07-16	40.73	30,000.00	1,221,900.00
2020061900000584	601601	中国太保	2020-06-19	2020-07-17	27.25	300,000.00	8,175,000.00
2020062300000556	600362	江西铜业	2020-06-23	2020-07-21	13.46	12,700.00	170,942.00
2020062300000559	600516	方大炭素	2020-06-23	2020-07-21	6.28	30,000.00	188,400.00
2020062300000561	600516	方大炭素	2020-06-23	2020-07-21	6.28	20,000.00	125,600.00
2020062300000562	600516	方大炭素	2020-06-23	2020-07-21	6.28	30,000.00	188,400.00
2020062300000590	600588	用友	2020-06-23	2020-07-21	44.10	37,000.00	1,631,700.00

		网络					
2020062300000601	600109	国金证券	2020-06-23	2020-07-21	11.41	80,000.00	912,800.00
2020062300000607	601162	天风证券	2020-06-23	2020-07-21	6.06	50,000.00	303,000.00
2020062300000613	601162	天风证券	2020-06-23	2020-07-21	6.06	150,000.00	909,000.00
2020062300000615	601162	天风证券	2020-06-23	2020-07-21	6.06	30,000.00	181,800.00
2020062300000618	601162	天风证券	2020-06-23	2020-07-21	6.06	75,000.00	454,500.00
2020062300000657	601800	中国交建	2020-06-23	2020-07-07	7.34	72,000.00	528,480.00
2020062300000679	601021	春秋航空	2020-06-23	2020-07-21	35.24	27,000.00	951,480.00
2020062300000683	600061	国投资本	2020-06-23	2020-07-21	12.73	14,000.00	178,220.00
2020062300000703	603658	安图生物	2020-06-23	2020-07-07	162.44	20,000.00	3,248,800.00
2020062300000742	601117	中国化学	2020-06-23	2020-07-07	5.48	11,700.00	64,116.00
2020062300000755	601601	中国	2020-06-23	2020-07-21	27.25	100,000.00	2,725,000.00

		太保					
2020062300000764	601601	中国太保	2020-06-23	2020-07-21	27.25	17,000.00	463,250.00
2020062300000769	601601	中国太保	2020-06-23	2020-07-21	27.25	300,000.00	8,175,000.00
2020062300000773	600111	北方稀土	2020-06-23	2020-07-21	9.32	104,000.00	969,280.00
2020062300000776	600297	广汇汽车	2020-06-23	2020-07-07	3.19	693,900.00	2,213,541.00
2020062300000780	601788	光大证券	2020-06-23	2020-07-07	16.06	50,000.00	803,000.00
2020062300000783	601788	光大证券	2020-06-23	2020-07-07	16.06	50,000.00	803,000.00
2020062300000793	601788	光大证券	2020-06-23	2020-07-21	16.06	70,000.00	1,124,200.00
2020062300000797	600977	中国电影	2020-06-23	2020-07-21	13.13	38,000.00	498,940.00
2020062300000804	601788	光大证券	2020-06-23	2020-07-21	16.06	100,000.00	1,606,000.00
2020062300000806	601901	方正证券	2020-06-23	2020-07-21	7.08	139,000.00	984,120.00
2020062300000809	601186	中国	2020-06-23	2020-07-07	8.38	65,400.00	548,052.00

		铁建					
2020062300000813	600183	生益科技	2020-06-23	2020-07-21	29.27	16,000.00	468,320.00
2020062300001570	600118	中国卫星	2020-06-23	2020-07-21	30.83	18,300.00	564,189.00
2020062300001572	603799	华友钴业	2020-06-23	2020-07-21	38.86	25,000.00	971,500.00
2020062300001616	600068	葛洲坝	2020-06-23	2020-07-07	5.95	117,500.00	699,125.00
2020062300001622	601212	白银有色	2020-06-23	2020-07-07	2.55	30,000.00	76,500.00
2020062300001626	600795	国电电力	2020-06-23	2020-07-07	1.85	39,900.00	73,815.00
2020062300001628	600522	中天科技	2020-06-23	2020-07-07	11.45	50,000.00	572,500.00
2020062300001630	600297	广汇汽车	2020-06-23	2020-07-07	3.19	147,400.00	470,206.00
2020062300001664	601066	中信建投	2020-06-23	2020-07-21	39.38	20,000.00	787,600.00
2020062300001748	600516	方大炭素	2020-06-23	2020-07-07	6.28	10,000.00	62,800.00
2020062400006455	600118	中国卫	2020-06-24	2020-07-22	30.83	70,000.00	2,158,100.00

		星					
2020062400006517	603986	兆易创新	2020-06-24	2020-07-22	235.91	30,000.00	7,077,300.00
2020062400006519	600309	万华化学	2020-06-24	2020-07-22	49.99	23,000.00	1,149,770.00
2020062400006565	600196	复星医药	2020-06-24	2020-07-22	33.85	10,000.00	338,500.00
2020062900000807	601066	中信建投	2020-06-29	2020-07-27	39.38	15,000.00	590,700.00
2020062900000956	601108	财通证券	2020-06-29	2020-07-27	10.25	700,000.00	7,175,000.00
2020062900001221	601788	光大证券	2020-06-29	2020-07-27	16.06	380,000.00	6,102,800.00
2020062900002788	601360	三六零	2020-06-29	2020-07-13	18.31	20,000.00	366,200.00
2020062900002790	600183	生益科技	2020-06-29	2020-07-13	29.27	20,000.00	585,400.00
2020062900002792	600221	海航控股	2020-06-29	2020-07-13	1.50	60,000.00	90,000.00
2020062900002794	600482	中国动力	2020-06-29	2020-07-13	15.70	32,900.00	516,530.00
2020062900002824	600516	方大炭素	2020-06-29	2020-07-13	6.28	80,000.00	502,400.00

2020062900002838	603799	华友钴业	2020-06-29	2020-07-13	38.86	30,000.00	1,165,800.00
2020062900002840	600498	烽火通信	2020-06-29	2020-07-13	28.91	50,000.00	1,445,500.00
2020062900003416	600588	用友网络	2020-06-29	2020-07-13	44.10	11,000.00	485,100.00
2020062900003420	600570	恒生电子	2020-06-29	2020-07-13	107.70	16,000.00	1,723,200.00
2020062900003426	600104	上汽集团	2020-06-29	2020-07-27	16.99	10,000.00	169,900.00
2020062900003428	601138	工业富联	2020-06-29	2020-07-27	15.15	10,000.00	151,500.00
2020062900003430	600196	复星医药	2020-06-29	2020-07-27	33.85	10,000.00	338,500.00
2020062900003432	601688	华泰证券	2020-06-29	2020-07-27	18.80	10,000.00	188,000.00
2020062900003434	603259	药明康德	2020-06-29	2020-07-27	96.60	10,000.00	966,000.00
2020062900003438	600887	伊利股份	2020-06-29	2020-07-27	31.13	20,000.00	622,600.00
2020062900003442	601012	隆基股份	2020-06-29	2020-07-27	40.73	10,000.00	407,300.00

2020062900003444	603899	晨光文具	2020-06-29	2020-07-27	54.60	10,000.00	546,000.00
2020062900003446	603019	中科曙光	2020-06-29	2020-07-27	38.40	10,000.00	384,000.00
2020062900003594	600516	方大炭素	2020-06-29	2020-07-27	6.28	21,200.00	133,136.00
2020062900003672	600183	生益科技	2020-06-29	2020-07-27	29.27	46,000.00	1,346,420.00
2020062900003674	601319	中国人保	2020-06-29	2020-07-27	6.44	587,800.00	3,785,432.00
2020062900003694	600009	上海机场	2020-06-29	2020-07-27	72.07	10,000.00	720,700.00
2020062900003716	600516	方大炭素	2020-06-29	2020-07-13	6.28	33,000.00	207,240.00
2020062900003724	600010	宝钢股份	2020-06-29	2020-07-13	1.08	900,000.00	972,000.00
2020062900003730	600703	三安光电	2020-06-29	2020-07-13	25.00	30,000.00	750,000.00
2020062900004212	600516	方大炭素	2020-06-29	2020-07-27	6.28	70,000.00	439,600.00
2020063000008010	600482	中国动力	2020-06-30	2020-07-28	15.70	31,000.00	486,700.00

2020063000008012	600115	东方航空	2020-06-30	2020-07-28	4.22	168,000.00	708,960.00
2020063000008198	600977	中国电影	2020-06-30	2020-07-28	13.13	53,000.00	695,890.00
2020063000008282	600025	华能水电	2020-06-30	2020-07-28	3.79	195,000.00	739,050.00
2020063000008298	601021	春秋航空	2020-06-30	2020-07-28	35.24	20,000.00	704,800.00
2020063000008322	600398	海澜之家	2020-06-30	2020-07-28	5.82	115,000.00	669,300.00
2020063000008372	600004	白云机场	2020-06-30	2020-07-28	15.24	39,000.00	594,360.00
2020063000008818	603799	华友钴业	2020-06-30	2020-07-14	38.86	10,000.00	388,600.00
合计						50,244,319.00	785,768,351.65

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基

金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 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	26,811,376,986.62	99.11	31,000,078,052.75	99.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,002,500.00	0.03	975,100.00	0.00
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	26,818,379,486.62	99.13	31,001,053,152.75	99.55

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	+5%	1,359,850,783.34	1,551,651,253.36
	-5%	-1,359,850,783.34	-1,551,651,253.36

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### (2) 各层次金融工具公允价值

截至 2020 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 26,597,984,581.19 元，第二层次的余额为 220,394,886.33 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2019 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 30,978,753,001.87 元，第二层次的余额为 22,300,150.88 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### (3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

##### (4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §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	26,811,376,986.62	98.84
	其中：股票	26,811,376,986.62	98.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,002,500.00	0.03
	其中：债券	7,002,500.00	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	273,776,324.67	1.01
8	其他各项资产	34,319,553.00	0.13
9	合计	27,126,475,364.29	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 785,768,351.65 元, 占本基金期末资产净值的 2.90%。

## 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	398,962,331.80	1.47
B	采矿业	647,598,476.38	2.39
C	制造业	12,867,934,580.18	47.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	546,201,740.08	2.02
E	建筑业	531,466,550.23	1.96
F	批发和零售业	276,438,921.32	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	753,159,969.80	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,097,213,571.61	4.06
J	金融业	7,588,922,794.29	28.05
K	房地产业	1,003,553,477.19	3.71
L	租赁和商务服务业	383,402,652.63	1.42
M	科学研究和技术服务业	181,404,463.80	0.67
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	34,113,463.50	0.13
Q	卫生和社会工作	326,940,303.76	1.21
R	文化、体育和娱乐业	174,063,670.95	0.64

S	综合	-	-
	合计	26,811,376,967.52	99.11

## 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	19,624,925	1,401,219,645.00	5.18
2	600519	贵州茅台	910,011	1,331,236,891.68	4.92
3	600036	招商银行	18,685,543	630,076,509.96	2.33
4	600276	恒瑞医药	6,729,201	621,105,252.30	2.30
5	000858	五 粮 液	3,516,052	601,666,818.24	2.22
6	000333	美的集团	8,875,765	530,681,989.35	1.96
7	000651	格力电器	8,718,324	493,195,588.68	1.82
8	002475	立讯精密	7,591,549	389,826,041.15	1.44
9	600030	中信证券	15,432,882	372,086,785.02	1.38
10	601166	兴业银行	22,581,055	356,329,047.90	1.32
11	600887	伊利股份	10,988,596	342,074,993.48	1.26
12	000002	万 科 A	12,331,172	322,336,836.08	1.19
13	601398	工商银行	63,499,439	316,227,206.22	1.17
14	600900	长江电力	15,941,725	301,936,271.50	1.12
15	601888	中国中免	1,765,907	272,002,655.21	1.01
16	601328	交通银行	49,775,046	255,345,985.98	0.94
17	300059	东方财富	11,680,590	235,947,918.00	0.87
18	600585	海螺水泥	4,347,434	230,022,732.94	0.85
19	000725	京东方 A	49,083,000	229,217,610.00	0.85
20	600000	浦发银行	21,269,825	225,034,748.50	0.83
21	000001	平安银行	17,580,734	225,033,395.20	0.83
22	000661	长春高新	513,508	223,530,032.40	0.83
23	002714	牧原股份	2,716,358	222,741,356.00	0.82
24	603288	海天味业	1,760,696	219,030,582.40	0.81
25	600016	民生银行	38,545,930	218,555,423.10	0.81
26	002415	海康威视	6,773,221	205,567,257.35	0.76
27	600031	三一重工	10,697,251	200,680,428.76	0.74
28	601688	华泰证券	10,652,758	200,271,850.40	0.74
29	601012	隆基股份	4,783,590	194,835,620.70	0.72
30	000063	中兴通讯	4,887,042	193,944,995.46	0.72
31	600048	保利地产	12,970,221	191,699,866.38	0.71
32	600837	海通证券	14,660,132	184,424,460.56	0.68
33	603259	药明康德	1,877,893	181,404,463.80	0.67
34	601668	中国建筑	38,001,137	181,265,423.49	0.67
35	300498	温氏股份	8,083,531	176,220,975.80	0.65
36	601288	农业银行	52,050,925	175,932,126.50	0.65

37	600570	恒生电子	1,513,066	162,957,208.20	0.60
38	300015	爱尔眼科	3,648,197	158,514,159.65	0.59
39	000100	TCL 科技	24,507,779	151,948,229.80	0.56
40	601229	上海银行	18,013,475	149,511,842.50	0.55
41	300142	沃森生物	2,785,297	145,838,150.92	0.54
42	002142	宁波银行	5,442,420	142,972,373.40	0.53
43	600309	万华化学	2,843,969	142,170,010.31	0.53
44	601211	国泰君安	8,169,312	141,002,325.12	0.52
45	603986	兆易创新	597,168	140,658,102.88	0.52
46	601601	中国太保	4,928,457	134,300,453.25	0.50
47	601988	中国银行	38,182,752	132,875,976.96	0.49
48	601169	北京银行	26,811,319	131,375,463.10	0.49
49	002352	顺丰控股	2,399,050	130,993,035.00	0.48
50	600588	用友网络	2,942,579	129,767,733.90	0.48
51	600009	上海机场	1,745,032	125,764,456.24	0.46
52	601766	中国中车	22,033,093	122,724,328.01	0.45
53	600690	海尔智家	6,857,504	121,377,820.80	0.45
54	000568	泸州老窖	1,326,924	120,909,314.88	0.45
55	002241	歌尔股份	4,115,964	120,844,703.04	0.45
56	000338	潍柴动力	8,683,448	119,136,906.56	0.44
57	002594	比亚迪	1,642,062	117,900,051.60	0.44
58	300122	智飞生物	1,159,719	116,145,857.85	0.43
59	002304	洋河股份	1,092,450	114,860,193.00	0.42
60	002410	广联达	1,638,125	114,177,312.50	0.42
61	000876	新 希 望	3,819,043	113,807,481.40	0.42
62	600999	招商证券	5,180,052	113,702,141.40	0.42
63	600703	三安光电	4,432,888	110,822,200.00	0.41
64	601899	紫金矿业	24,906,400	109,588,160.00	0.41
65	600104	上汽集团	6,349,779	107,882,745.21	0.40
66	002555	三七互娱	2,295,742	107,440,725.60	0.40
67	002230	科大讯飞	2,787,214	104,325,420.02	0.39
68	002027	分众传媒	18,613,259	103,675,852.63	0.38
69	601818	光大银行	28,848,882	103,278,997.56	0.38
70	600745	闻泰科技	814,400	102,573,680.00	0.38
71	300601	康泰生物	609,263	98,798,088.08	0.37
72	002007	华兰生物	1,983,468	97,327,581.48	0.36
73	300347	泰格医药	950,079	96,794,048.52	0.36
74	600919	江苏银行	16,714,919	94,773,590.73	0.35
75	600028	中国石化	24,225,613	94,722,146.83	0.35
76	001979	招商蛇口	5,734,828	94,280,572.32	0.35
77	600436	片仔癀	546,741	93,082,655.25	0.34
78	000538	云南白药	925,362	86,808,209.22	0.32
79	600547	山东黄金	2,354,820	86,233,508.40	0.32

80	601088	中国神华	5,972,247	85,761,466.92	0.32
81	600406	国电南瑞	4,186,078	84,768,079.50	0.31
82	300413	芒果超媒	1,290,275	84,125,930.00	0.31
83	000895	双汇发展	1,804,362	83,163,044.58	0.31
84	300003	乐普医疗	2,259,247	82,507,700.44	0.30
85	000166	申万宏源	16,330,577	82,469,413.85	0.30
86	601628	中国人寿	3,017,681	82,111,100.01	0.30
87	600050	中国联通	16,862,100	81,612,564.00	0.30
88	600438	通威股份	4,660,226	80,994,727.88	0.30
89	002271	东方雨虹	1,990,910	80,890,673.30	0.30
90	300014	亿纬锂能	1,666,771	79,754,992.35	0.29
91	601009	南京银行	10,877,055	79,728,813.15	0.29
92	000938	紫光股份	1,851,128	79,561,481.44	0.29
93	002129	中环股份	3,531,953	79,327,664.38	0.29
94	601939	建设银行	12,165,885	76,766,734.35	0.28
95	002371	北方华创	448,818	76,707,484.38	0.28
96	601006	大秦铁路	10,773,000	75,841,920.00	0.28
97	000776	广发证券	5,362,140	75,713,416.80	0.28
98	300136	信维通信	1,401,231	74,293,267.62	0.27
99	002460	赣锋锂业	1,385,647	74,229,109.79	0.27
100	601390	中国中铁	14,753,809	74,064,121.18	0.27
101	600196	复星医药	2,185,777	73,988,551.45	0.27
102	601857	中国石油	17,596,902	73,731,019.38	0.27
103	600019	宝钢股份	16,138,997	73,593,826.32	0.27
104	603160	汇顶科技	331,000	73,511,100.00	0.27
105	603019	中科曙光	1,887,326	72,473,318.40	0.27
106	002044	美年健康	4,970,999	71,632,095.59	0.26
107	000977	浪潮信息	1,827,933	71,618,414.94	0.26
108	300124	汇川技术	1,882,559	71,518,416.41	0.26
109	002050	三花智控	3,253,200	71,245,080.00	0.26
110	601186	中国铁建	8,336,000	69,855,680.00	0.26
111	600809	山西汾酒	473,844	68,707,380.00	0.25
112	002602	世纪华通	4,512,471	68,371,931.01	0.25
113	600015	华夏银行	11,149,062	68,232,259.44	0.25
114	002311	海大集团	1,431,453	68,122,848.27	0.25
115	002001	新 和 成	2,335,242	67,955,542.20	0.25
116	002624	完美世界	1,171,282	67,014,294.48	0.25
117	601336	新华保险	1,511,107	66,911,817.96	0.25
118	300433	蓝思科技	2,382,579	66,807,515.16	0.25
119	601989	中国重工	16,515,264	66,061,056.00	0.24
120	601933	永辉超市	6,935,360	65,053,676.80	0.24
121	603501	韦尔股份	313,382	63,287,494.90	0.23
122	002456	欧菲光	3,417,415	62,846,261.85	0.23

123	002236	大华股份	3,263,956	62,700,594.76	0.23
124	600958	东方证券	6,485,300	61,545,497.00	0.23
125	000157	中联重科	9,398,570	60,432,805.10	0.22
126	600183	生益科技	2,061,900	60,351,813.00	0.22
127	600352	浙江龙盛	4,715,313	60,308,853.27	0.22
128	600741	华域汽车	2,855,773	59,371,520.67	0.22
129	002024	苏宁易购	6,746,015	59,162,551.55	0.22
130	601377	兴业证券	8,492,295	58,172,220.75	0.22
131	601788	光大证券	3,537,700	56,815,462.00	0.21
132	600383	金地集团	4,089,554	56,026,889.80	0.21
133	002008	大族激光	1,546,570	55,599,191.50	0.21
134	002463	沪电股份	2,187,044	54,632,359.12	0.20
135	601138	工业富联	3,599,964	54,539,454.60	0.20
136	000860	顺鑫农业	940,368	53,582,168.64	0.20
137	600346	恒力石化	3,825,279	53,553,906.00	0.20
138	600660	福耀玻璃	2,540,431	53,018,794.97	0.20
139	601901	方正证券	7,452,211	52,761,653.88	0.20
140	300408	三环集团	1,889,398	52,336,324.60	0.19
141	601225	陕西煤业	7,246,229	52,245,311.09	0.19
142	300033	同花顺	389,987	51,899,469.96	0.19
143	002120	韵达股份	2,101,285	51,376,418.25	0.19
144	601877	正泰电器	1,947,715	51,322,290.25	0.19
145	601155	新城控股	1,635,042	51,078,712.08	0.19
146	600522	中天科技	4,443,500	50,878,075.00	0.19
147	002736	国信证券	4,456,357	50,356,834.10	0.19
148	000425	徐工机械	8,514,912	50,323,129.92	0.19
149	600109	国金证券	4,383,037	50,010,452.17	0.18
150	600340	华夏幸福	2,183,520	49,915,267.20	0.18
151	002202	金风科技	5,002,139	49,871,325.83	0.18
152	300144	宋城演艺	2,842,526	49,175,699.80	0.18
153	601669	中国电建	13,854,280	47,935,808.80	0.18
154	002841	视源股份	475,435	47,315,291.20	0.17
155	000783	长江证券	7,012,312	47,262,982.88	0.17
156	603993	洛阳钼业	12,802,248	46,984,250.16	0.17
157	603799	华友钴业	1,240,775	46,877,116.50	0.17
158	601800	中国交建	6,383,564	46,855,359.76	0.17
159	601108	财通证券	4,550,900	46,646,725.00	0.17
160	601985	中国核电	11,276,843	46,122,287.87	0.17
161	601555	东吴证券	5,624,038	45,892,150.08	0.17
162	600089	特变电工	6,728,494	45,551,904.38	0.17
163	603369	今世缘	1,136,681	45,228,536.99	0.17
164	000069	华侨城 A	7,429,427	45,022,327.62	0.17
165	600867	通化东宝	2,576,538	44,909,057.34	0.17

166	600010	包钢股份	41,262,325	44,563,311.00	0.16
167	000768	中航飞机	2,508,308	44,497,383.92	0.16
168	002916	深南电路	257,876	43,199,387.52	0.16
169	002493	荣盛石化	3,419,784	42,063,343.20	0.16
170	000066	中国长城	3,182,800	42,012,960.00	0.16
171	600029	南方航空	8,007,044	41,396,417.48	0.15
172	002179	中航光电	996,849	40,880,777.49	0.15
173	600606	绿地控股	6,612,109	40,862,833.62	0.15
174	600487	亨通光电	2,475,901	40,629,535.41	0.15
175	000963	华东医药	1,584,763	40,094,503.90	0.15
176	002157	正邦科技	2,267,342	39,633,138.16	0.15
177	600795	国电电力	21,356,285	39,509,127.25	0.15
178	600061	国投资本	3,062,920	38,990,971.60	0.14
179	000625	长安汽车	3,533,300	38,866,300.00	0.14
180	600886	国投电力	4,917,500	38,651,550.00	0.14
181	600705	中航资本	9,756,346	38,635,130.16	0.14
182	601100	恒立液压	479,625	38,465,925.00	0.14
183	601607	上海医药	2,090,300	38,419,714.00	0.14
184	002422	科伦药业	1,826,202	38,350,242.00	0.14
185	600926	杭州银行	4,297,206	38,331,077.52	0.14
186	600893	航发动力	1,630,056	38,273,714.88	0.14
187	603658	安图生物	233,765	37,972,786.60	0.14
188	600111	北方稀土	3,949,451	36,808,883.32	0.14
189	600498	烽火通信	1,272,976	36,801,736.16	0.14
190	002466	天齐锂业	1,603,531	36,801,036.45	0.14
191	603899	晨光文具	672,130	36,698,298.00	0.14
192	601162	天风证券	6,038,500	36,593,310.00	0.14
193	601066	中信建投	925,100	36,430,438.00	0.13
194	600637	东方明珠	3,711,251	35,813,572.15	0.13
195	601111	中国国航	5,413,678	35,784,411.58	0.13
196	600176	中国巨石	3,806,526	34,829,712.90	0.13
197	600115	东方航空	8,118,500	34,260,070.00	0.13
198	002607	中公教育	1,229,314	34,113,463.50	0.13
199	002601	龙蟠佰利	1,840,999	34,058,481.50	0.13
200	600011	华能国际	7,963,849	33,607,442.78	0.12
201	601360	三六零	1,838,474	33,536,458.94	0.12
202	600233	圆通速递	2,292,858	33,384,012.48	0.12
203	300628	亿联网络	488,893	33,371,836.18	0.12
204	601727	上海电气	6,620,040	33,365,001.60	0.12
205	601816	京沪高铁	5,337,200	33,250,756.00	0.12
206	600118	中国卫星	1,070,691	33,009,403.53	0.12
207	600332	白云山	1,018,370	32,923,902.10	0.12
208	600271	航天信息	2,024,647	32,880,267.28	0.12

209	601600	中国铝业	11,844,546	32,690,946.96	0.12
210	000786	北新建材	1,530,217	32,639,528.61	0.12
211	601618	中国中冶	12,934,800	32,466,348.00	0.12
212	003816	中国广核	10,690,400	31,643,584.00	0.12
213	000656	金科股份	3,869,900	31,578,384.00	0.12
214	000596	古井贡酒	208,204	31,280,568.96	0.12
215	600221	海航控股	20,844,400	31,266,600.00	0.12
216	601838	成都银行	3,926,850	31,257,726.00	0.12
217	002252	上海莱士	3,663,902	30,996,610.92	0.11
218	600489	中金黄金	3,364,522	30,751,731.08	0.11
219	000728	国元证券	3,657,991	30,727,124.40	0.11
220	000703	恒逸石化	3,335,146	30,449,882.98	0.11
221	601919	中远海控	8,766,927	30,421,236.69	0.11
222	600177	雅戈尔	5,031,491	29,987,686.36	0.11
223	000961	中南建设	3,361,104	29,913,825.60	0.11
224	600068	葛洲坝	5,005,245	29,781,207.75	0.11
225	600066	宇通客车	2,406,089	29,354,285.80	0.11
226	601997	贵阳银行	4,081,054	29,220,346.64	0.11
227	600390	五矿资本	4,074,642	28,766,972.52	0.11
228	601998	中信银行	5,552,278	28,594,231.70	0.11
229	600004	白云机场	1,874,760	28,571,342.40	0.11
230	601198	东兴证券	2,497,700	27,224,930.00	0.10
231	600085	同仁堂	993,497	26,943,638.64	0.10
232	601881	中国银河	2,335,400	26,787,038.00	0.10
233	002508	老板电器	859,536	26,740,164.96	0.10
234	600018	上港集团	6,297,339	26,448,823.80	0.10
235	603833	欧派家居	228,064	26,432,617.60	0.10
236	600219	南山铝业	12,989,481	26,368,646.43	0.10
237	600516	方大炭素	4,137,130	25,981,176.40	0.10
238	601231	环旭电子	1,185,800	25,897,872.00	0.10
239	002673	西部证券	3,172,970	25,891,435.20	0.10
240	601018	宁波港	7,160,000	25,561,200.00	0.09
241	002146	荣盛发展	3,151,392	25,526,275.20	0.09
242	600998	九州通	1,360,724	25,336,680.88	0.09
243	600362	江西铜业	1,880,069	25,305,728.74	0.09
244	600760	中航沈飞	761,000	24,976,020.00	0.09
245	600655	豫园股份	2,814,340	24,935,052.40	0.09
246	601319	中国人保	3,858,100	24,846,164.00	0.09
247	600170	上海建工	8,065,375	24,760,701.25	0.09
248	601117	中国化学	4,467,500	24,481,900.00	0.09
249	601878	浙商证券	2,415,147	23,934,106.77	0.09
250	002773	康弘药业	476,186	23,618,825.60	0.09
251	600369	西南证券	5,113,158	23,469,395.22	0.09

252	600297	广汇汽车	7,346,941	23,436,741.79	0.09
253	601021	春秋航空	664,356	23,411,905.44	0.09
254	600848	上海临港	1,084,661	23,287,671.67	0.09
255	600208	新湖中宝	7,789,353	23,212,271.94	0.09
256	002739	万达电影	1,506,058	22,997,505.66	0.09
257	002153	石基信息	580,418	22,653,714.54	0.08
258	002938	鹏鼎控股	460,900	22,508,454.00	0.08
259	002958	青农商行	5,032,200	22,292,646.00	0.08
260	601658	邮储银行	4,861,300	22,216,141.00	0.08
261	600674	川投能源	2,392,120	22,174,952.40	0.08
262	600038	中直股份	534,129	21,936,678.03	0.08
263	002032	苏泊尔	298,070	21,162,970.00	0.08
264	002939	长城证券	1,686,306	20,775,289.92	0.08
265	600027	华电国际	5,901,588	20,183,430.96	0.07
266	603156	养元饮品	916,753	19,710,189.50	0.07
267	002558	巨人网络	1,100,613	19,150,666.20	0.07
268	000671	阳光城	2,967,152	18,811,743.68	0.07
269	000627	天茂集团	3,580,672	18,655,301.12	0.07
270	601992	金隅集团	6,043,300	18,492,498.00	0.07
271	600482	中国动力	1,174,600	18,441,220.00	0.07
272	600583	海油工程	4,004,600	18,220,930.00	0.07
273	002468	申通快递	1,109,884	18,213,196.44	0.07
274	600977	中国电影	1,352,973	17,764,535.49	0.07
275	601633	长城汽车	2,201,712	16,997,216.64	0.06
276	000709	河钢股份	7,694,900	15,697,596.00	0.06
277	601216	君正集团	6,114,866	15,531,759.64	0.06
278	601916	浙商银行	3,934,500	15,501,930.00	0.06
279	601238	广汽集团	1,680,960	15,128,640.00	0.06
280	601577	长沙银行	1,859,000	14,760,460.00	0.05
281	600188	兖州煤业	1,608,502	14,090,477.52	0.05
282	601808	中海油服	1,072,200	14,088,708.00	0.05
283	601236	红塔证券	724,000	14,045,600.00	0.05
284	600398	海澜之家	2,401,822	13,978,604.04	0.05
285	000723	美锦能源	2,227,800	13,946,028.00	0.05
286	601698	中国卫通	724,600	13,050,046.00	0.05
287	600372	中航电子	955,964	12,733,440.48	0.05
288	600928	西安银行	2,416,049	12,708,417.74	0.05
289	601898	中煤能源	3,316,300	12,601,940.00	0.05
290	600025	华能水电	3,261,300	12,360,327.00	0.05
291	600989	宝丰能源	1,461,308	12,304,213.36	0.05
292	000708	中信特钢	640,239	10,941,684.51	0.04
293	601077	渝农商行	2,082,800	9,830,816.00	0.04
294	600968	海油发展	3,681,900	8,578,827.00	0.03

295	601828	美凯龙	729,381	7,724,144.79	0.03
296	601298	青岛港	1,270,100	7,214,168.00	0.03
297	603260	合盛硅业	254,620	6,961,310.80	0.03
298	601212	白银有色	2,683,100	6,841,905.00	0.03
299	002945	华林证券	489,500	6,759,995.00	0.02
300	600299	安迪苏	534,700	6,534,034.00	0.02
301	688126	沪硅产业	220,528	5,808,707.52	0.02
302	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.00
303	688200	华峰测控	3,780	1,020,675.60	0.00
304	688085	三友医疗	8,807	595,529.34	0.00
305	688051	佳华科技	4,053	487,454.31	0.00
306	688026	洁特生物	4,433	369,357.56	0.00
307	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
308	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
309	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
310	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
311	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
312	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
313	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
314	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
315	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
316	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
317	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
318	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

注：报告期内“中信证券”系投资人申购交付组合证券被动持有。

#### 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	000651	格力电器	263,174,574.08	0.85
2	000333	美的集团	243,083,321.29	0.78
3	000858	五粮液	227,965,046.37	0.73
4	000661	长春高新	204,523,327.39	0.66
5	000002	万科A	180,584,811.20	0.58
6	000063	中兴通讯	151,930,359.28	0.49
7	601398	工商银行	132,955,861.96	0.43
8	002475	立讯精密	128,960,157.30	0.41
9	000001	平安银行	124,220,796.48	0.40
10	000725	京东方A	112,514,714.72	0.36
11	002415	海康威视	108,144,385.72	0.35

12	300498	温氏股份	106,255,706.28	0.34
13	300601	康泰生物	96,825,910.15	0.31
14	600745	闻泰科技	94,215,774.73	0.30
15	002352	顺丰控股	91,107,627.35	0.29
16	300059	东方财富	83,097,034.77	0.27
17	002714	牧原股份	81,757,567.95	0.26
18	000977	浪潮信息	80,065,757.53	0.26
19	002371	北方华创	80,018,696.51	0.26
20	300014	亿纬锂能	75,976,367.00	0.24

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	393,506,051.25	1.26
2	000333	美的集团	368,590,137.65	1.18
3	000858	五粮液	366,809,028.22	1.18
4	000661	长春高新	246,408,705.00	0.79
5	002475	立讯精密	209,237,271.06	0.67
6	000002	万科A	206,564,889.57	0.66
7	600519	贵州茅台	186,201,021.75	0.60
8	000001	平安银行	184,095,663.69	0.59
9	000063	中兴通讯	180,088,107.84	0.58
10	002415	海康威视	162,337,952.17	0.52
11	300498	温氏股份	154,488,334.54	0.50
12	000725	京东方A	136,813,930.11	0.44
13	601318	中国平安	135,223,848.36	0.43
14	300059	东方财富	131,738,723.61	0.42
15	002714	牧原股份	126,368,457.71	0.41
16	002304	洋河股份	103,093,721.96	0.33
17	601166	兴业银行	102,673,316.87	0.33
18	000100	TCL 科技	102,379,287.19	0.33
19	002142	宁波银行	101,280,215.75	0.33
20	000338	潍柴动力	90,977,011.73	0.29

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	6,912,970,253.36
卖出股票的收入（成交）总额	8,820,743,614.48

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不

考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	7,002,500.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,002,500.00	0.03

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128112	歌尔转 2	54,706	5,470,600.00	0.02
2	128114	正邦转债	15,319	1,531,900.00	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	沪深 300 股指期货 IF2007	180	222,372,000.00	7,902,300.00	买入股指期货合约的目的是进行更有

	合约				效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计					7,902,300.00
股指期货投资本期收益					7,530,326.21
股指期货投资本期公允价值变动					2,675,724.00

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 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	23,837,334.05
2	应收证券清算款	7,408,379.18
3	应收股利	2,443,906.80
4	应收利息	629,932.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,319,553.00

##### 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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		华夏沪深 300ETF 联接	
		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
11,077	581,524.77	2,924,691,284.00	45.40%	180,465,996.00	2.80%	3,336,392,548.00	51.79%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	1,790,942,652.00	27.80%
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	293,470,500.00	4.56%
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	113,483,600.00	1.76%
4	中国人寿保险股份有限公司	107,234,075.00	1.66%
5	信达证券股份有限公司	98,400,000.00	1.53%
6	汇丰人寿保险有限公司—增额红利分红保险产品	40,680,600.00	0.63%
7	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品（财富管	40,178,200.00	0.62%

	家) 委托专户		
8	中信证券股份有限公司	38,919,813.00	0.60%
9	国泰君安证券股份有限公司	35,986,246.00	0.56%
10	中国建设银行股份有限公司—民生加银康宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)	29,000,000.00	0.45%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,336,392,548.00	51.79%

### 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	-	-

### 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 (2012 年 12 月 25 日) 基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	7,471,149,828
本报告期基金总申购份额	3,083,400,000
减：本报告期基金总赎回份额	4,113,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,441,549,828

## §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，本基金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 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

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

本基金本报告期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

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 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

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	3	4,439,336,517.49	28.26%	584,368.20	33.89%	-
中信证券	4	4,017,172,442.40	25.57%	339,202.39	19.67%	-
中国银河证券	4	3,662,897,847.11	23.31%	449,370.17	26.06%	-
粤开证券	1	2,918,211,779.71	18.57%	237,265.95	13.76%	-
中银国际证券	1	414,553,454.74	2.64%	54,432.17	3.16%	-
招商证券	2	147,976,315.26	0.94%	12,028.95	0.70%	-
中金公司	2	110,462,690.14	0.70%	47,643.53	2.76%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 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。

ii 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。

③除本表列示外，本基金还选择了长城证券、长江证券、东北证券、东方证券、方正证券、国盛证券、华安证券、上海证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、中投证券、中泰证券、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，国盛证券、华安证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，国泰君安证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-
中信证券	4,047,254.00	13.07%	-	-
中国银河证券	19,644,775.69	63.45%	-	-
粤开证券	-	-	-	-
中银国际证券	7,268,727.40	23.48%	-	-
招商证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-

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	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金利润分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-08
2	华夏基金管理有限公司关于修订旗下上海证券交易所跨市场股票 ETF 基金合同、招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-15
3	华夏基金管理有限公司关于根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
4	华夏基金管理有限公司关于旗下上交所上市	中国证监会指定报刊及	2020-03-13

	基金新增启用扩位证券简称的公告	网站	
5	华夏基金管理有限公司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、招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-24
6	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
7	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01

## §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
机构	1	2020-01-01 至 2020-06-30	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	27.80%
华夏沪深 300ETF 联接	1	2020-01-01 至 2020-06-30	3,989,471,756.00	709,062,692.00	1,362,141,900.00	3,336,392,548.00	51.79%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。							

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

#### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

#### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司  
二〇二〇年八月二十九日