

南方中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF（中证 1000ETF）
基金主代码	512100
交易代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	218,892,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“1000ETF”或“中证 1000ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 1000 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201

注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	张海波	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

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 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	28,011,213.81
本期利润	29,692,951.29
加权平均基金份额本期利润	0.1125
本期加权平均净值利润率	14.78%
本期基金份额净值增长率	17.06%
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	-35,960,539.51
期末可供分配基金份额利润	-0.1643
期末基金资产净值	182,931,460.49
期末基金份额净值	0.8357
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	-16.43%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.18%	0.89%	8.65%	0.89%	0.53%	0.00%
过去三个月	18.30%	1.23%	16.44%	1.23%	1.86%	0.00%
过去六个月	17.06%	1.90%	13.52%	1.88%	3.54%	0.02%
过去一年	29.35%	1.56%	18.76%	1.56%	10.59%	0.00%
过去三年	-2.46%	1.54%	-15.35%	1.54%	12.89%	0.00%
自基金合同生效起至今	-16.43%	1.44%	-26.45%	1.45%	10.02%	-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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 10000 亿元，旗下管理 220 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔蕾	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	5 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理师(FRM)，特许金融分析师(CFA)，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF(QDII)基金经理；2019 年 6 月 28 日至今，任大数据 300 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF、南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，

					任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2020 年 3 月 26 日至今，任南方粤港澳大湾区联接基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 3 次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内中证 1000 指数上涨 13.52%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- (4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8357 元，报告期内，份额净值增长率为 17.06%，同期业绩基准增长率为 13.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受疫情影响，全球经济放缓，但 A 股显示较强韧性，境内外对 A 股配置关注度提升。展望下半年，海内外货币政策保持宽松，随着全球复工，经济逐渐回暖，国内资本市场加速开放，预期中长期资金持续流入。大中华地区权益市场不少优质资产，凸显长期配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定,当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》;本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;本基金收益分配采取现金分红方式;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	2,491,994.54	1,838,386.70
结算备付金		1,436,233.95	2,687,024.13
存出保证金		640,277.17	912,103.47
交易性金融资产	6.4.4.2	178,796,685.90	194,481,829.44
其中：股票投资		178,707,885.90	194,401,229.44
基金投资		-	-
债券投资		88,800.00	80,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		603,345.76	-
应收利息	6.4.4.5	832.94	2,794.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		183,969,370.26	199,922,137.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	138,316.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		86,297.50	96,302.22
应付托管费		17,259.51	19,260.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	35,203.11	19,419.42
应交税费		5,458.52	18,825.28
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	893,691.13	522,931.83
负债合计		1,037,909.77	815,055.63
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	218,892,000.00	278,892,000.00
未分配利润	6.4.4.10	-35,960,539.51	-79,784,917.84
所有者权益合计		182,931,460.49	199,107,082.16
负债和所有者权益总计		183,969,370.26	199,922,137.79

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8357 元，基金份额总额 218,892,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		30,874,681.17	26,816,974.49
1. 利息收入		32,353.82	22,577.31
其中：存款利息收入	6.4.4.11	32,242.06	22,462.80
债券利息收入		111.76	114.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,301,107.66	4,284,331.96
其中：股票投资收益	6.4.4.12	27,675,639.33	2,584,918.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	68,658.76	12,585.64
资产支持证券投资	6.4.4.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	398,116.50	285,941.75
股利收益	6.4.4.17	1,158,693.07	1,400,885.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	1,681,737.48	22,344,972.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	-140,517.79	165,092.71
减：二、费用		1,181,729.88	1,076,676.91
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	496,231.53	448,596.78
2. 托管费	6.4.7.2.2	99,246.30	89,719.34
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-

4. 交易费用	6. 4. 4. 20	424, 818. 69	313, 342. 46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1, 433. 62	1, 029. 76
7. 其他费用	6. 4. 4. 21	159, 999. 74	223, 988. 57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29, 692, 951. 29	25, 740, 297. 58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29, 692, 951. 29	25, 740, 297. 58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	278, 892, 000. 00	-79, 784, 917. 84	199, 107, 082. 16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29, 692, 951. 29	29, 692, 951. 29
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）	-60, 000, 000. 00	14, 131, 427. 04	-45, 868, 572. 96
其中：1. 基金申购款	333, 000, 000. 00	-73, 045, 025. 55	259, 954, 974. 45
2. 基金赎回款	-393, 000, 000. 00	87, 176, 452. 59	-305, 823, 547. 41
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)	218,892,000.00	-35,960,539.51	182,931,460.49
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)	227,892,000.00	-107,027,026.41	120,864,973.59
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	25,740,297.58	25,740,297.58
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数(净值减少以 “-”号填列)	93,000,000.00	-32,281,138.39	60,718,861.61
其中: 1. 基金申购款	492,000,000.00	-162,733,774.42	329,266,225.58
2. 基金赎回款	-399,000,000.00	130,452,636.03	-268,547,363.97
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动(净 值减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	320,892,000.00	-113,567,867.22	207,324,132.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**6.4.3.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.4 重要财务报表项目的说明**6.4.4.1 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	2,491,994.54
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	2,491,994.54

6.4.4.2 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	165,410,791.16	178,707,885.90	13,297,094.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	88,800.00	88,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	88,800.00	88,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	165,499,591.16	178,796,685.90	13,297,094.74
----	----------------	----------------	---------------

注：于 2020 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2019 年 12 月 31 日：60.00 元)。

6.4.4.3 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			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,457,090.00	-	-	-
—股指期货	4,457,090.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,457,090.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 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	230.33
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	546.60
应收债券利息	18.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	37.60
合计	832.94

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.7 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	35,203.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	35,203.11

6.4.4.8 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	-
应退替代款	722,245.45
预提费用	87,021.48
应付指数使用费	70,000.00
可退替代款	14,424.20
其他	-
合计	893,691.13

1. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.4.9 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	278,892,000.00	278,892,000.00
本期申购	333,000,000.00	333,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-393,000,000.00	-393,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	218,892,000.00	218,892,000.00

6.4.4.10 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	-50,175,926.18	-29,608,991.66	-79,784,917.84
本期利润	28,011,213.81	1,681,737.48	29,692,951.29
本期基金份额交易产生的变动数	5,059,384.13	9,072,042.91	14,131,427.04
其中：基金申购款	-43,666,535.30	-29,378,490.25	-73,045,025.55
基金赎回款	48,725,919.43	38,450,533.16	87,176,452.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,105,328.24	-18,855,211.27	-35,960,539.51

6.4.4.11 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	10,981.49
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	20,510.72
其他	749.85
合计	32,242.06

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 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	24,906,243.97
股票投资收益——赎回差价收入	2,769,395.36
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	27,675,639.33

6.4.4.12.2 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	299,126,691.90
减：卖出股票成本总额	274,220,447.93
买卖股票差价收入	24,906,243.97

6.4.4.12.3 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	305,823,547.41
减：现金支付赎回款总额	208,888,690.41
减：赎回股票成本总额	94,165,461.64
赎回差价收入	2,769,395.36

6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.4.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.4.13 债券投资收益

6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	68,658.76
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	68,658.76

6.4.4.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	513,258.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	444,500.00
减：应收利息总额	100.16
买卖债券差价收入	68,658.76

6.4.4.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.4.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.4.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.4.15 贵金属投资收益

6.4.4.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.4.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.4.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.4.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	398,116.50

6.4.4.17 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	1,158,693.07
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,158,693.07

6.4.4.18 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	1,573,637.48
——股票投资	1,573,637.48
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	108,100.00
——权证投资	-
——期货投资	108,100.00
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,681,737.48

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为-60.00 元(2019 上半年度：0.00 元)。

6.4.4.19 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	-140,517.79
合计	-140,517.79

替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.4.20 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	424,818.69
银行间市场交易费用	-
合计	424,818.69

6.4.4.21 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	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	2,978.26
合计	159,999.74

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。于 2019 年度，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元；自 2020 年度起，当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 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
华泰证券	166,596,660.33	28.68%	71,947,245.96	14.74%

6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
华泰证券	16,661.03	28.68%	11,686.04	33.20%
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
华泰证券	7,194.83	14.74%	5,909.75	20.15%

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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	496,231.53	448,596.78
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.7.2.2 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	99,246.30	89,719.34

支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.7.2.3 销售服务费

无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.7.4 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

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

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

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

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

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.5.2 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

无。

6.4.7.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,491,994.54	10,981.49	4,283,893.37	11,449.09

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
300607	拓斯达	2019 年 11 月 14 日	2020 年 8 月 11 日	增发未上市	22.47	40.69	805	18,085.62	32,755.45	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300845	捷安高科	2020 年	2020 年	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

		6月24日	7月3日	上市						
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	1,934	69,972.12	69,972.12	-
688090	瑞松科技	2020年2月7日	2020年8月17日	科创板新股锁定期	27.55	59.45	3,013	83,008.15	179,122.85	-
688222	成都先导	2020年4月3日	2020年10月16日	科创板新股锁定期	20.52	43.70	5,334	109,453.68	233,095.80	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	6,474	104,943.54	104,943.54	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股未上市	15.50	15.50	4,283	66,386.50	66,386.50	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113586	上机转债	2020年6月10日	2020年7月7日	配债未上市	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.00	-
113588	润达转债	2020年6月18日	2020年7月13日	配债未上市	100.00	100.00	130	13,000.00	13,000.00	-
123053	宝通转债	2020年6月5日	2020年7月1日	配债未上市	100.00	100.00	166	16,600.00	16,600.00	-
127017	万青转债	2020年6月3日	2020年7月2日	配债未上市	100.00	100.00	254	25,400.00	25,400.00	-
128110	永兴转债	2020年6月9日	2020年7月8日	配债未上市	100.00	100.00	198	19,800.00	19,800.00	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规

定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000597	东北制药	2020年6月24日	重大事项停牌	5.22	2020年7月1日	5.37	27,158	140,214.24	141,764.76	-
000662	*ST天夏	2020年6月30日	重大事项停牌	2.48	2020年7月1日	2.36	25,700	94,752.59	63,736.00	-
002254	泰和新材	2020年6月29日	重大事项停牌	13.60	2020年7月14日	14.96	17,000	203,654.82	231,200.00	-
002638	*ST勤上	2020年6月30日	重大事项停牌	2.10	2020年7月1日	2.00	30,100	81,789.41	63,210.00	-
600069	退市银鸽	2020年6月10日	重大事项停牌	0.92	尚未复牌	-	36,500	63,221.44	33,580.00	-
600090	*ST济堂	2020年6月30日	重大事项停牌	2.90	2020年7月1日	2.76	32,700	118,402.63	94,830.00	-
600185	格力地产	2020年6月30日	重大事项停牌	11.61	2020年7月1日	12.77	46,900	358,984.26	544,509.00	-
600226	*ST瀚叶	2020年4月30日	重大事项停牌	2.35	2020年7月1日	2.23	24,994	71,811.40	58,735.90	-
600242	*ST中昌	2020年6月30日	重大事项停牌	6.35	2020年7月1日	6.03	10,600	76,749.32	67,310.00	-

					日				
--	--	--	--	--	---	--	--	--	--

本基金截至 2020 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 1000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险

损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05% (2019 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%)。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	2,491,994.54	-	-	-	2,491,994.54
结算备付金	1,436,233.95	-	-	-	1,436,233.95
存出保证金	83,534.77	-	-	556,742.40	640,277.17
交易性金融资产	-	-	88,800.00	178,707,885.90	178,796,685.90
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	832.94	832.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	603,345.76	603,345.76
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,011,763.26	-	88,800.00	179,868,807.00	183,969,370.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	86,297.50	86,297.50
应付托管费	-	-	-	17,259.51	17,259.51
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	35,203.11	35,203.11
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,458.52	5,458.52
其他负债	-	-	-	893,691.13	893,691.13
负债总计	-	-	-	1,037,909.77	1,037,909.77
利率敏感度缺口	4,011,763.26	-	88,800.00	178,830,897.23	182,931,460.49
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,838,386.70	-	-	-	1,838,386.70
结算备付金	2,687,024.13	-	-	-	2,687,024.13
存出保证金	156,199.47	-	-	755,904.00	912,103.47

交易性金融资产	-	-	80,600.00	194,401,229.44	194,481,829.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,794.05	2,794.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,681,610.30	-	80,600.00	195,159,927.49	199,922,137.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	96,302.22	96,302.22
应付托管费	-	-	-	19,260.46	19,260.46
应付证券清算款	-	-	-	138,316.42	138,316.42
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	19,419.42	19,419.42
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	18,825.28	18,825.28
其他负债	-	-	-	522,931.83	522,931.83
负债总计	-	-	-	815,055.63	815,055.63
利率敏感度缺口	4,681,610.30	-	80,600.00	194,344,871.86	199,107,082.16

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.05%(2019 年 12 月 31 日: 0.04%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日:同)。

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 1000 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

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	178,707,885.90	97.69	194,401,229.44	97.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	178,707,885.90	97.69	194,401,229.44	97.64

其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2020年6月)	上年度末(2019年12月)

	30 日)	月 31 日)
1.组合自身基准上升 5%	9,050,864.67	9,768,193.45
2.组合自身基准下降 5%	-9,050,864.67	-9,768,193.45

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	178,707,885.90	97.14
	其中：股票	178,707,885.90	97.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	88,800.00	0.05
	其中：债券	88,800.00	0.05
	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	3,928,228.49	2.14
8	其他资产	1,244,455.87	0.68
9	合计	183,969,370.26	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,612,354.75	0.88
B	采矿业	3,330,767.22	1.82
C	制造业	111,906,218.75	61.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,692,638.16	2.02
E	建筑业	4,037,485.01	2.21
F	批发和零售业	6,396,190.01	3.50

G	交通运输、仓储和邮政业	3,441,433.84	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,151,068.29	13.20
J	金融业	2,045,391.00	1.12
K	房地产业	5,565,362.96	3.04
L	租赁和商务服务业	2,071,811.68	1.13
M	科学研究和技术服务业	3,391,849.64	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	3,090,899.00	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	76,872.80	0.04
Q	卫生和社会工作	521,237.64	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,794,588.20	0.98
S	综合	713,856.00	0.39
	合计	177,840,024.95	97.22

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	495,849.72	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,041.11	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	233,095.80	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	9,108.00	0.00
	合计	867,860.95	0.47

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300661	圣邦股份	3,370	1,028,018.50	0.56
2	300676	华大基因	6,000	935,460.00	0.51
3	002065	东华软件	71,000	888,920.00	0.49
4	300463	迈克生物	14,900	867,627.00	0.47
5	300326	凯利泰	27,400	797,340.00	0.44
6	000799	酒鬼酒	8,700	665,637.00	0.36
7	300724	捷佳伟创	7,300	646,269.00	0.35
8	300699	光威复材	9,920	622,281.60	0.34
9	002436	兴森科技	45,300	581,199.00	0.32
10	603005	晶方科技	7,300	574,218.00	0.31
11	002683	宏大爆破	16,200	565,380.00	0.31
12	002402	和而泰	34,750	563,297.50	0.31
13	300502	新易盛	8,900	561,768.00	0.31
14	002400	省广集团	53,100	557,019.00	0.30
15	600984	建设机械	22,100	548,080.00	0.30
16	300451	创业慧康	29,550	546,379.50	0.30
17	600185	格力地产	46,900	544,509.00	0.30
18	300037	新宙邦	9,500	523,070.00	0.29
19	603345	安井食品	4,400	519,200.00	0.28
20	300223	北京君正	5,099	514,693.06	0.28
21	000540	中天金融	159,600	513,912.00	0.28
22	002123	梦网集团	25,000	495,000.00	0.27
23	002481	双塔食品	28,400	491,888.00	0.27
24	000710	贝瑞基因	8,100	483,894.00	0.26
25	300457	赢合科技	15,025	478,997.00	0.26
26	300598	诚迈科技	2,500	473,500.00	0.26
27	002332	仙琚制药	27,800	468,152.00	0.26
28	002409	雅克科技	8,900	464,313.00	0.25
29	300346	南大光电	10,700	461,384.00	0.25
30	603708	家家悦	9,362	461,172.12	0.25
31	002100	天康生物	28,400	457,240.00	0.25
32	300226	上海钢联	5,800	455,880.00	0.25
33	002568	百润股份	10,000	453,200.00	0.25
34	600988	赤峰黄金	38,000	452,200.00	0.25
35	300379	东方通	10,500	451,815.00	0.25
36	002791	坚朗五金	4,800	451,632.00	0.25
37	600882	妙可蓝多	12,400	449,996.00	0.25

38	002675	东诚药业	21,300	446,235.00	0.24
39	603520	司太立	5,300	445,518.00	0.24
40	002705	新宝股份	12,100	441,408.00	0.24
41	300073	当升科技	13,200	436,524.00	0.24
42	300036	超图软件	17,200	433,096.00	0.24
43	300054	鼎龙股份	25,980	431,268.00	0.24
44	600641	万业企业	18,300	430,050.00	0.24
45	600305	恒顺醋业	22,984	426,353.20	0.23
46	300476	胜宏科技	17,660	424,723.00	0.23
47	300369	绿盟科技	18,100	421,549.00	0.23
48	603881	数据港	3,900	421,473.00	0.23
49	603456	九洲药业	15,300	414,630.00	0.23
50	000818	航锦科技	18,200	406,406.00	0.22
51	600812	华北制药	31,100	400,879.00	0.22
52	002727	一心堂	10,700	397,077.00	0.22
53	300674	宇信科技	9,200	396,980.00	0.22
54	603027	千禾味业	12,560	396,644.80	0.22
55	300236	上海新阳	6,600	396,396.00	0.22
56	002214	大立科技	13,900	391,702.00	0.21
57	603686	龙马环卫	15,860	386,508.20	0.21
58	300725	药石科技	3,110	386,417.50	0.21
59	300685	艾德生物	5,020	386,339.20	0.21
60	600720	祁连山	23,700	385,125.00	0.21
61	600323	瀚蓝环境	17,600	385,088.00	0.21
62	300747	锐科激光	3,500	380,905.00	0.21
63	002425	凯撒文化	21,660	380,349.60	0.21
64	000403	双林生物	5,100	378,063.00	0.21
65	300567	精测电子	5,500	375,375.00	0.21
66	600873	梅花生物	82,400	374,096.00	0.20
67	300294	博雅生物	9,950	373,025.50	0.20
68	002647	仁东控股	10,500	372,540.00	0.20
69	002126	银轮股份	30,200	369,648.00	0.20
70	000672	上峰水泥	15,500	365,955.00	0.20
71	002467	二六三	51,780	364,013.40	0.20
72	300348	长亮科技	19,150	363,850.00	0.20
73	002216	三全食品	15,200	363,280.00	0.20
74	000034	神州数码	14,900	362,666.00	0.20
75	300188	美亚柏科	18,280	362,492.40	0.20
76	601636	旗滨集团	61,200	362,304.00	0.20
77	300118	东方日升	24,100	361,500.00	0.20
78	002025	航天电器	9,854	360,459.32	0.20
79	300363	博腾股份	10,400	359,424.00	0.20
80	002351	漫步者	17,000	359,040.00	0.20

81	000735	罗牛山	35,000	358,400.00	0.20
82	002581	未名医药	12,500	356,375.00	0.19
83	002643	万润股份	20,750	356,277.50	0.19
84	603638	艾迪精密	6,796	356,110.40	0.19
85	300078	思创医惠	26,320	356,109.60	0.19
86	603737	三棵树	3,860	355,969.20	0.19
87	002023	海特高新	23,100	355,047.00	0.19
88	600546	山煤国际	30,200	354,850.00	0.19
89	002036	联创电子	28,290	353,625.00	0.19
90	002151	北斗星通	11,000	352,330.00	0.19
91	603127	昭衍新药	3,340	351,134.20	0.19
92	300766	每日互动	9,200	350,152.00	0.19
93	002706	良信电器	20,900	348,612.00	0.19
94	002912	中新赛克	2,100	343,539.00	0.19
95	000035	中国天楹	67,300	343,230.00	0.19
96	600459	贵研铂业	11,506	342,993.86	0.19
97	300298	三诺生物	10,580	340,041.20	0.19
98	002697	红旗连锁	31,100	339,612.00	0.19
99	600252	中恒集团	105,600	338,976.00	0.19
100	600702	舍得酒业	9,000	336,150.00	0.18
101	002497	雅化集团	36,400	335,972.00	0.18
102	600635	大众公用	73,618	335,698.08	0.18
103	300770	新媒股份	1,500	335,490.00	0.18
104	300526	中潜股份	2,700	335,340.00	0.18
105	300458	全志科技	8,908	327,814.40	0.18
106	600797	浙大网新	39,700	327,128.00	0.18
107	002063	远光软件	25,700	324,591.00	0.18
108	002262	恩华药业	19,240	324,386.40	0.18
109	300098	高新兴	53,520	324,331.20	0.18
110	000951	中国重汽	10,300	321,978.00	0.18
111	002413	雷科防务	41,800	321,024.00	0.18
112	600206	有研新材	22,600	315,722.00	0.17
113	600267	海正药业	22,000	315,700.00	0.17
114	600621	华鑫股份	16,200	312,660.00	0.17
115	300352	北信源	44,100	310,905.00	0.17
116	600559	老白干酒	24,004	310,851.80	0.17
117	600966	博汇纸业	30,600	310,590.00	0.17
118	000733	振华科技	13,700	308,113.00	0.17
119	601519	大智慧	37,900	305,474.00	0.17
120	300373	扬杰科技	9,100	305,032.00	0.17
121	000503	国新健康	27,300	304,122.00	0.17
122	603039	泛微网络	3,918	302,704.68	0.17
123	600330	天通股份	30,340	302,489.80	0.17

124	600491	龙元建设	34,900	301,536.00	0.16
125	300031	宝通科技	12,000	300,480.00	0.16
126	300395	菲利华	9,100	299,117.00	0.16
127	300666	江丰电子	5,000	298,400.00	0.16
128	300792	壹网壹创	1,700	296,072.00	0.16
129	002310	东方园林	61,100	295,113.00	0.16
130	603678	火炬电子	10,500	294,210.00	0.16
131	002099	海翔药业	37,000	292,670.00	0.16
132	600211	西藏药业	4,580	291,837.60	0.16
133	002597	金禾实业	12,700	291,719.00	0.16
134	600517	国网英大	43,543	290,867.24	0.16
135	002389	航天彩虹	21,600	290,520.00	0.16
136	300573	兴齐眼药	2,000	290,000.00	0.16
137	002605	姚记科技	7,600	288,800.00	0.16
138	300659	中孚信息	4,800	288,096.00	0.16
139	002326	永太科技	23,472	287,766.72	0.16
140	000016	深康佳 A	42,500	287,300.00	0.16
141	300702	天宇股份	2,700	287,064.00	0.16
142	000851	高鸿股份	34,480	285,149.60	0.16
143	002237	恒邦股份	20,700	282,969.00	0.15
144	002106	莱宝高科	21,500	282,510.00	0.15
145	000903	云内动力	52,500	282,450.00	0.15
146	002022	科华生物	15,700	281,815.00	0.15
147	000555	神州信息	18,300	281,454.00	0.15
148	300709	精研科技	2,900	278,835.00	0.15
149	300397	天和防务	11,340	276,809.40	0.15
150	300233	金城医药	9,000	276,750.00	0.15
151	603596	伯特利	7,800	274,560.00	0.15
152	600601	方正科技	83,300	274,057.00	0.15
153	600993	马应龙	11,300	274,025.00	0.15
154	002251	步步高	19,600	274,008.00	0.15
155	002851	麦格米特	10,550	273,456.00	0.15
156	300572	安车检测	4,300	273,265.00	0.15
157	000917	电广传媒	43,100	272,392.00	0.15
158	300737	科顺股份	13,800	272,274.00	0.15
159	300525	博思软件	7,400	272,098.00	0.15
160	300456	赛微电子	9,830	271,504.60	0.15
161	600711	盛屯矿业	52,800	271,392.00	0.15
162	000591	太阳能	80,040	270,535.20	0.15
163	300132	青松股份	11,700	270,270.00	0.15
164	600503	华丽家族	60,800	268,128.00	0.15
165	002035	华帝股份	26,300	266,419.00	0.15
166	000582	北部湾港	24,800	266,352.00	0.15

167	603236	移远通信	1,280	266,240.00	0.15
168	600246	万通地产	31,300	262,607.00	0.14
169	603393	新天然气	7,124	262,519.40	0.14
170	300394	天孚通信	4,400	262,020.00	0.14
171	002292	奥飞娱乐	31,100	261,862.00	0.14
172	603713	密尔克卫	2,500	260,050.00	0.14
173	000667	美好置业	93,800	258,888.00	0.14
174	600131	国网信通	13,600	257,992.00	0.14
175	300170	汉得信息	26,800	257,816.00	0.14
176	300083	劲胜智能	43,500	257,520.00	0.14
177	300079	数码科技	54,200	257,450.00	0.14
178	000831	五矿稀土	22,430	256,150.60	0.14
179	300038	数知科技	31,300	255,408.00	0.14
180	002079	苏州固锝	19,300	254,181.00	0.14
181	601058	赛轮轮胎	71,900	253,807.00	0.14
182	600360	华微电子	29,300	253,152.00	0.14
183	000936	华西股份	20,200	252,500.00	0.14
184	300339	润和软件	24,300	251,991.00	0.14
185	600604	市北高新	26,700	251,247.00	0.14
186	300068	南都电源	23,500	250,510.00	0.14
187	300149	量子生物	13,300	249,907.00	0.14
188	000793	华闻集团	60,600	249,672.00	0.14
189	600093	易见股份	21,300	249,636.00	0.14
190	300523	辰安科技	5,270	246,846.80	0.13
191	002698	博实股份	19,350	246,712.50	0.13
192	002626	金达威	9,500	246,620.00	0.13
193	600789	鲁抗医药	26,730	245,114.10	0.13
194	000006	深振业 A	35,900	244,479.00	0.13
195	000652	泰达股份	39,100	244,375.00	0.13
196	000810	创维数字	20,200	244,016.00	0.13
197	600986	科达股份	50,440	243,625.20	0.13
198	000516	国际医学	60,100	243,405.00	0.13
199	002239	奥特佳	59,580	243,086.40	0.13
200	000875	吉电股份	65,300	242,916.00	0.13
201	600803	新奥股份	23,400	241,956.00	0.13
202	300633	开立医疗	6,100	241,865.00	0.13
203	300327	中颖电子	7,460	241,704.00	0.13
204	002324	普利特	16,100	241,661.00	0.13
205	002798	帝欧家居	7,400	240,278.00	0.13
206	600850	华东电脑	9,800	240,198.00	0.13
207	601375	中原证券	50,900	239,230.00	0.13
208	002261	拓维信息	29,300	239,088.00	0.13
209	000688	国城矿业	12,900	239,037.00	0.13

210	300497	富祥药业	12,140	237,579.80	0.13
211	300751	迈为股份	800	237,568.00	0.13
212	600864	哈投股份	39,400	236,794.00	0.13
213	002020	京新药业	22,100	236,249.00	0.13
214	002498	汉缆股份	50,600	235,796.00	0.13
215	002171	楚江新材	25,200	235,368.00	0.13
216	002859	洁美科技	7,800	233,844.00	0.13
217	002959	小熊电器	1,900	233,700.00	0.13
218	603588	高能环境	20,000	233,200.00	0.13
219	000915	山大华特	7,110	232,852.50	0.13
220	000789	万年青	18,070	232,560.90	0.13
221	300053	欧比特	21,400	232,404.00	0.13
222	002254	泰和新材	17,000	231,200.00	0.13
223	000429	粤高速 A	33,000	230,670.00	0.13
224	002421	达实智能	58,900	228,532.00	0.12
225	002301	齐心集团	13,900	228,238.00	0.12
226	603613	国联股份	2,410	226,540.00	0.12
227	600612	老凤祥	4,700	226,493.00	0.12
228	002428	云南锗业	19,800	225,720.00	0.12
229	600756	浪潮软件	12,200	225,700.00	0.12
230	000049	德赛电池	4,600	225,446.00	0.12
231	600057	厦门象屿	40,966	224,493.68	0.12
232	603308	应流股份	11,000	224,400.00	0.12
233	600456	宝钛股份	8,200	224,270.00	0.12
234	300623	捷捷微电	7,420	222,971.00	0.12
235	603368	柳药股份	9,709	222,821.55	0.12
236	603718	海利生物	12,200	222,772.00	0.12
237	300663	科蓝软件	8,000	221,680.00	0.12
238	300406	九强生物	9,600	220,800.00	0.12
239	300568	星源材质	11,806	219,827.72	0.12
240	000902	新洋丰	24,800	219,232.00	0.12
241	300123	亚光科技	19,060	218,618.20	0.12
242	601222	林洋能源	40,000	218,400.00	0.12
243	600868	梅雁吉祥	72,200	218,044.00	0.12
244	002777	久远银海	7,160	217,735.60	0.12
245	600320	振华重工	75,680	217,201.60	0.12
246	603606	东方电缆	14,900	216,646.00	0.12
247	002449	国星光电	18,650	216,340.00	0.12
248	300735	光弘科技	11,712	216,086.40	0.12
249	002091	江苏国泰	35,630	215,561.50	0.12
250	002042	华孚时尚	34,600	215,558.00	0.12
251	002194	武汉凡谷	10,400	215,280.00	0.12
252	603601	再升科技	16,400	214,840.00	0.12

253	300085	银之杰	13,400	214,668.00	0.12
254	300638	广和通	3,560	213,956.00	0.12
255	600110	诺德股份	43,800	213,744.00	0.12
256	600378	昊华科技	10,400	213,096.00	0.12
257	603323	吴江银行	47,890	212,631.60	0.12
258	600490	鹏欣资源	67,500	212,625.00	0.12
259	300045	华力创通	16,500	211,695.00	0.12
260	000070	特发信息	21,740	211,312.80	0.12
261	300322	硕贝德	12,300	210,822.00	0.12
262	603118	共进股份	17,700	210,453.00	0.12
263	000921	海信家电	17,300	210,368.00	0.11
264	300398	飞凯材料	9,960	210,355.20	0.11
265	300748	金力永磁	6,300	210,294.00	0.11
266	600771	广誉远	14,960	209,888.80	0.11
267	600685	中船防务	12,400	209,684.00	0.11
268	600129	太极集团	14,800	209,272.00	0.11
269	600363	联创光电	13,500	209,115.00	0.11
270	002430	杭氧股份	14,700	208,740.00	0.11
271	300815	玉禾田	1,700	208,488.00	0.11
272	300429	强力新材	11,620	207,765.60	0.11
273	600337	美克家居	47,002	207,748.84	0.11
274	002850	科达利	3,000	207,600.00	0.11
275	300143	盈康生命	12,400	206,832.00	0.11
276	603018	中设集团	21,160	205,886.80	0.11
277	300624	万兴科技	2,540	204,470.00	0.11
278	300319	麦捷科技	18,400	204,424.00	0.11
279	002950	奥美医疗	7,200	204,336.00	0.11
280	601137	博威合金	13,000	203,320.00	0.11
281	600562	国睿科技	13,710	203,182.20	0.11
282	000976	华铁股份	36,400	203,112.00	0.11
283	000931	中关村	20,000	202,800.00	0.11
284	002531	天顺风能	33,700	201,526.00	0.11
285	002168	惠程科技	24,500	201,145.00	0.11
286	300292	吴通控股	38,900	201,113.00	0.11
287	300020	银江股份	17,600	200,640.00	0.11
288	300607	拓斯达	4,925	200,398.25	0.11
289	603258	电魂网络	3,600	200,016.00	0.11
290	300303	聚飞光电	33,900	199,671.00	0.11
291	000901	航天科技	19,562	199,336.78	0.11
292	300203	聚光科技	11,900	199,087.00	0.11
293	000823	超声电子	14,300	198,913.00	0.11
294	603043	广州酒家	6,100	198,372.00	0.11
295	600210	紫江企业	46,200	198,198.00	0.11

296	002222	福晶科技	12,900	197,886.00	0.11
297	603489	八方股份	1,400	197,386.00	0.11
298	600422	昆药集团	20,200	197,152.00	0.11
299	603387	基蛋生物	4,888	196,937.52	0.11
300	600055	万东医疗	12,300	196,923.00	0.11
301	000650	仁和药业	32,800	196,800.00	0.11
302	002695	煌上煌	7,800	196,716.00	0.11
303	002276	万马股份	27,500	196,350.00	0.11
304	002291	星期六	8,500	196,350.00	0.11
305	002446	盛路通信	27,310	195,266.50	0.11
306	300263	隆华科技	24,500	195,265.00	0.11
307	300185	通裕重工	99,300	194,628.00	0.11
308	000910	大亚圣象	12,500	194,250.00	0.11
309	000683	远兴能源	104,300	193,998.00	0.11
310	002459	晶澳科技	10,300	193,434.00	0.11
311	600662	强生控股	24,100	192,318.00	0.11
312	300284	苏交科	25,756	191,624.64	0.10
313	603583	捷昌驱动	2,800	191,464.00	0.10
314	600587	新华医疗	12,300	191,388.00	0.10
315	002747	埃斯顿	16,000	191,360.00	0.10
316	002055	得润电子	12,700	191,262.00	0.10
317	002145	中核钛白	42,300	191,196.00	0.10
318	002312	三泰控股	41,900	190,645.00	0.10
319	000546	金圆股份	18,900	190,323.00	0.10
320	600668	尖峰集团	13,000	189,540.00	0.10
321	600761	安徽合力	19,600	188,944.00	0.10
322	600116	三峡水利	21,100	187,579.00	0.10
323	300602	飞荣达	5,712	187,467.84	0.10
324	600108	亚盛集团	59,300	187,388.00	0.10
325	002320	海峡股份	17,025	187,275.00	0.10
326	002649	博彦科技	20,100	186,930.00	0.10
327	600420	现代制药	19,400	186,822.00	0.10
328	600326	西藏天路	26,220	186,686.40	0.10
329	600072	中船科技	16,900	185,562.00	0.10
330	600496	精工钢构	55,000	184,250.00	0.10
331	600596	新安股份	21,400	184,040.00	0.10
332	300377	赢时胜	19,650	183,531.00	0.10
333	603429	集友股份	5,760	183,340.80	0.10
334	002115	三维通信	19,070	183,072.00	0.10
335	002376	新北洋	17,900	182,401.00	0.10
336	002547	春兴精工	25,600	182,272.00	0.10
337	002545	东方铁塔	23,700	182,016.00	0.10
338	600750	江中药业	14,380	181,763.20	0.10

339	002610	爱康科技	136,500	181,545.00	0.10
340	600284	浦东建设	29,516	181,523.40	0.10
341	300232	洲明科技	22,434	181,491.06	0.10
342	002240	威华股份	14,100	181,467.00	0.10
343	300287	飞利信	43,700	181,355.00	0.10
344	002530	金财互联	14,800	181,152.00	0.10
345	002918	蒙娜丽莎	6,050	180,955.50	0.10
346	600624	复旦复华	18,100	180,819.00	0.10
347	002104	恒宝股份	21,216	180,548.16	0.10
348	002567	唐人神	18,950	180,404.00	0.10
349	601567	三星医疗	26,300	180,155.00	0.10
350	000933	神火股份	43,400	180,110.00	0.10
351	002258	利尔化学	10,100	180,083.00	0.10
352	002161	远望谷	22,501	180,008.00	0.10
353	000969	安泰科技	27,200	179,520.00	0.10
354	600602	云赛智联	24,600	178,596.00	0.10
355	600477	杭萧钢构	49,132	178,349.16	0.10
356	300664	鹏鹞环保	19,300	178,139.00	0.10
357	603599	广信股份	10,556	178,079.72	0.10
358	603826	坤彩科技	5,300	177,921.00	0.10
359	600499	科达洁能	43,100	177,572.00	0.10
360	600200	江苏吴中	27,000	177,390.00	0.10
361	002139	拓邦股份	31,500	177,345.00	0.10
362	601929	吉视传媒	82,700	176,978.00	0.10
363	002043	兔宝宝	20,600	175,718.00	0.10
364	603108	润达医疗	13,180	175,557.60	0.10
365	000088	盐田港	29,600	175,232.00	0.10
366	002717	岭南股份	40,735	175,160.50	0.10
367	601010	文峰股份	56,200	174,782.00	0.10
368	002135	东南网架	23,700	174,195.00	0.10
369	002596	海南瑞泽	26,100	173,826.00	0.10
370	300177	中海达	17,850	173,680.50	0.09
371	300075	数字政通	13,100	173,575.00	0.09
372	002364	中恒电气	12,800	173,440.00	0.09
373	300761	立华股份	4,500	173,430.00	0.09
374	600318	新力金融	13,600	173,264.00	0.09
375	002832	比音勒芬	10,120	173,254.40	0.09
376	000036	华联控股	39,350	173,140.00	0.09
377	300131	英唐智控	32,400	173,016.00	0.09
378	002097	山河智能	28,957	172,873.29	0.09
379	002484	江海股份	18,590	172,329.30	0.09
380	300119	瑞普生物	7,700	172,095.00	0.09
381	000560	我爱我家	53,630	171,616.00	0.09

382	603533	掌阅科技	4,500	171,585.00	0.09
383	000676	智度股份	20,080	171,483.20	0.09
384	600783	鲁信创投	11,200	171,360.00	0.09
385	600936	广西广电	44,500	171,325.00	0.09
386	600114	东睦股份	16,472	170,979.36	0.09
387	002298	中电兴发	21,000	170,730.00	0.09
388	300616	尚品宅配	2,840	170,627.20	0.09
389	000030	富奥股份	26,700	170,613.00	0.09
390	300184	力源信息	26,820	170,575.20	0.09
391	600059	古越龙山	18,300	170,556.00	0.09
392	300299	富春股份	18,795	170,094.75	0.09
393	601588	北辰实业	60,500	170,005.00	0.09
394	002733	雄韬股份	8,000	170,000.00	0.09
395	603989	艾华集团	5,850	169,767.00	0.09
396	300672	国科微	3,300	169,653.00	0.09
397	300741	华宝股份	4,600	169,648.00	0.09
398	300438	鹏辉能源	9,700	169,265.00	0.09
399	300194	福安药业	31,800	168,858.00	0.09
400	300034	钢研高纳	9,000	168,840.00	0.09
401	002041	登海种业	13,300	168,245.00	0.09
402	600851	海欣股份	22,500	168,075.00	0.09
403	000697	炼石航空	17,700	167,796.00	0.09
404	001696	宗申动力	26,000	167,440.00	0.09
405	002617	露笑科技	34,450	167,427.00	0.09
406	000989	九芝堂	16,600	167,328.00	0.09
407	002582	好想你	13,700	167,277.00	0.09
408	600063	皖维高新	51,300	167,238.00	0.09
409	300679	电连技术	5,227	167,159.46	0.09
410	002768	国恩股份	5,100	167,127.00	0.09
411	600831	广电网络	21,600	166,752.00	0.09
412	600391	航发科技	8,900	166,519.00	0.09
413	002383	合众思壮	17,100	165,699.00	0.09
414	601666	平煤股份	44,300	165,682.00	0.09
415	601908	京运通	38,000	165,680.00	0.09
416	002585	双星新材	26,320	165,552.80	0.09
417	600512	腾达建设	60,600	165,438.00	0.09
418	002182	云海金属	17,300	165,042.00	0.09
419	000059	华锦股份	36,500	164,980.00	0.09
420	600742	一汽富维	20,038	164,712.36	0.09
421	300101	振芯科技	14,900	164,645.00	0.09
422	603222	济民制药	4,800	164,640.00	0.09
423	002489	浙江永强	41,300	164,374.00	0.09
424	002308	威创股份	24,200	164,318.00	0.09

425	600197	伊力特	8,300	164,091.00	0.09
426	601011	宝泰隆	42,900	163,878.00	0.09
427	002117	东港股份	14,500	163,560.00	0.09
428	002515	金字火腿	25,960	163,028.80	0.09
429	600285	羚锐制药	17,400	162,690.00	0.09
430	002967	广电计量	6,000	162,600.00	0.09
431	002197	证通电子	15,700	162,495.00	0.09
432	002611	东方精工	35,200	162,272.00	0.09
433	603636	南威软件	13,399	162,127.90	0.09
434	600740	山西焦化	37,520	162,086.40	0.09
435	002657	中科金财	10,400	161,512.00	0.09
436	002672	东江环保	17,900	161,279.00	0.09
437	300256	星星科技	25,350	160,719.00	0.09
438	600846	同济科技	18,900	160,650.00	0.09
439	300455	康拓红外	10,800	160,380.00	0.09
440	300055	万邦达	26,200	160,344.00	0.09
441	300596	利安隆	4,600	160,218.00	0.09
442	601163	三角轮胎	12,100	160,204.00	0.09
443	300145	中金环境	51,260	159,931.20	0.09
444	300016	北陆药业	13,150	159,904.00	0.09
445	601369	陕鼓动力	25,400	159,766.00	0.09
446	000796	凯撒旅业	15,300	159,732.00	0.09
447	603609	禾丰牧业	10,700	159,430.00	0.09
448	002539	云图控股	23,100	159,390.00	0.09
449	002869	金溢科技	2,400	158,592.00	0.09
450	002367	康力电梯	18,100	158,013.00	0.09
451	603690	至纯科技	3,800	157,244.00	0.09
452	300171	东富龙	9,700	156,946.00	0.09
453	300248	新开普	12,691	156,860.76	0.09
454	300328	宜安科技	13,100	156,807.00	0.09
455	300657	弘信电子	7,800	156,546.00	0.09
456	002313	日海智能	8,400	156,240.00	0.09
457	300229	拓尔思	13,600	156,128.00	0.09
458	603218	日月股份	8,528	156,062.40	0.09
459	600611	大众交通	41,500	156,040.00	0.09
460	600510	黑牡丹	19,800	156,024.00	0.09
461	002822	中装建设	18,200	155,792.00	0.09
462	002609	捷顺科技	12,200	155,550.00	0.09
463	002047	宝鹰股份	30,700	155,342.00	0.08
464	600269	赣粤高速	44,500	155,305.00	0.08
465	300267	尔康制药	39,100	155,227.00	0.08
466	300401	花园生物	10,800	154,764.00	0.08
467	000829	天音控股	23,600	154,580.00	0.08

468	000900	现代投资	40,300	154,349.00	0.08
469	002512	达华智能	30,500	154,025.00	0.08
470	000603	盛达资源	13,100	153,925.00	0.08
471	000926	福星股份	29,300	153,825.00	0.08
472	300219	鸿利智汇	16,200	153,738.00	0.08
473	603920	世运电路	6,200	153,698.00	0.08
474	300552	万集科技	3,600	153,288.00	0.08
475	002234	民和股份	6,900	153,042.00	0.08
476	002130	沃尔核材	33,400	152,638.00	0.08
477	300353	东土科技	13,600	152,592.00	0.08
478	000592	平潭发展	58,800	152,292.00	0.08
479	000682	东方电子	30,700	152,272.00	0.08
480	603113	金能科技	12,800	152,192.00	0.08
481	000836	富通鑫茂	46,100	152,130.00	0.08
482	300448	浩云科技	15,900	151,845.00	0.08
483	300130	新国都	11,040	151,800.00	0.08
484	600552	凯盛科技	23,300	151,450.00	0.08
485	600502	安徽建工	39,100	150,926.00	0.08
486	002341	新纶科技	30,700	150,123.00	0.08
487	601952	苏垦农发	15,810	149,878.80	0.08
488	300310	宜通世纪	26,740	149,744.00	0.08
489	002668	奥马电器	32,856	149,494.80	0.08
490	600366	宁波韵升	26,200	149,340.00	0.08
491	300349	金卡智能	9,900	148,995.00	0.08
492	002277	友阿股份	37,200	148,800.00	0.08
493	002283	天润工业	34,200	148,770.00	0.08
494	300007	汉威科技	9,000	148,770.00	0.08
495	300755	华致酒行	4,580	148,392.00	0.08
496	000720	新能泰山	29,500	148,090.00	0.08
497	002083	孚日股份	27,600	147,936.00	0.08
498	603666	亿嘉和	1,680	147,436.80	0.08
499	300495	美尚生态	15,450	147,084.00	0.08
500	002550	千红制药	34,000	146,880.00	0.08
501	300662	科锐国际	3,300	146,850.00	0.08
502	000795	英洛华	25,700	146,747.00	0.08
503	300158	振东制药	27,400	146,590.00	0.08
504	600483	福能股份	20,000	145,200.00	0.08
505	600636	国新文化	11,800	145,140.00	0.08
506	002235	安妮股份	17,800	145,070.00	0.08
507	300613	富瀚微	1,280	145,024.00	0.08
508	603298	杭叉集团	13,160	145,023.20	0.08
509	300590	移为通信	4,450	144,892.00	0.08
510	300604	长川科技	4,700	144,713.00	0.08

511	300238	冠昊生物	8,100	144,261.00	0.08
512	600308	华泰股份	31,218	143,602.80	0.08
513	002970	锐明技术	2,100	143,493.00	0.08
514	002565	顺灏股份	28,200	143,256.00	0.08
515	601677	明泰铝业	16,500	143,220.00	0.08
516	000155	川能动力	29,000	142,970.00	0.08
517	002488	金固股份	26,900	142,570.00	0.08
518	600577	精达股份	51,200	142,336.00	0.08
519	000597	东北制药	27,158	141,764.76	0.08
520	603026	石大胜华	5,300	141,457.00	0.08
521	002639	雪人股份	20,500	141,450.00	0.08
522	000913	钱江摩托	10,500	141,435.00	0.08
523	300183	东软载波	9,000	141,210.00	0.08
524	601918	新集能源	59,200	140,896.00	0.08
525	300209	天泽信息	8,200	140,712.00	0.08
526	600239	云南城投	36,707	140,587.81	0.08
527	300047	天源迪科	19,359	140,546.34	0.08
528	603111	康尼机电	22,700	140,513.00	0.08
529	002618	丹邦科技	14,550	140,407.50	0.08
530	300044	赛为智能	20,820	139,702.20	0.08
531	300137	先河环保	20,920	139,536.40	0.08
532	002034	旺能环境	8,000	139,520.00	0.08
533	002318	久立特材	19,100	139,430.00	0.08
534	600105	永鼎股份	33,040	139,428.80	0.08
535	600990	四创电子	3,511	139,386.70	0.08
536	002928	华夏航空	9,250	139,212.50	0.08
537	603887	城地股份	5,700	139,080.00	0.08
538	002479	富春环保	23,700	138,882.00	0.08
539	600480	凌云股份	12,390	138,768.00	0.08
540	002073	软控股份	35,500	138,095.00	0.08
541	603363	傲农生物	5,900	137,883.00	0.08
542	600975	新五丰	14,900	137,378.00	0.08
543	601890	亚星锚链	25,390	137,359.90	0.08
544	002537	海联金汇	23,640	137,348.40	0.08
545	002226	江南化工	23,800	137,326.00	0.08
546	300386	飞天诚信	8,000	136,960.00	0.07
547	000973	佛塑科技	29,500	136,880.00	0.07
548	002522	浙江众成	20,600	136,784.00	0.07
549	000801	四川九洲	23,400	136,656.00	0.07
550	002279	久其软件	18,830	136,517.50	0.07
551	300266	兴源环境	41,600	136,448.00	0.07
552	601069	西部黄金	9,800	135,534.00	0.07
553	002556	辉隆股份	16,400	135,464.00	0.07

554	300803	指南针	2,400	135,432.00	0.07
555	002573	清新环境	24,800	135,408.00	0.07
556	600550	保变电气	28,000	135,240.00	0.07
557	600736	苏州高新	26,200	135,192.00	0.07
558	300224	正海磁材	15,600	135,096.00	0.07
559	603128	华贸物流	23,200	134,792.00	0.07
560	300222	科大智能	16,600	134,626.00	0.07
561	002755	奥赛康	7,100	134,190.00	0.07
562	600622	光大嘉宝	34,141	134,174.13	0.07
563	603185	上机数控	2,738	134,134.62	0.07
564	600764	中国海防	5,300	134,090.00	0.07
565	002474	榕基软件	18,800	134,044.00	0.07
566	300441	鲍斯股份	12,440	133,978.80	0.07
567	600103	青山纸业	70,080	133,852.80	0.07
568	300190	维尔利	17,700	133,635.00	0.07
569	600855	航天长峰	8,400	133,560.00	0.07
570	300477	合纵科技	18,880	132,915.20	0.07
571	600449	宁夏建材	10,800	131,976.00	0.07
572	601965	中国汽研	15,100	131,672.00	0.07
573	002737	葵花药业	9,000	131,670.00	0.07
574	002838	道恩股份	4,500	131,355.00	0.07
575	600676	交运股份	23,590	131,160.40	0.07
576	002108	沧州明珠	37,789	131,127.83	0.07
577	300355	蒙草生态	48,740	131,110.60	0.07
578	600300	维维股份	44,600	130,678.00	0.07
579	000601	韶能股份	24,791	130,648.57	0.07
580	600400	红豆股份	38,620	130,535.60	0.07
581	000726	鲁泰 A	17,200	130,376.00	0.07
582	600523	贵航股份	7,680	130,252.80	0.07
583	600169	太原重工	68,100	130,071.00	0.07
584	603060	国检集团	6,500	129,935.00	0.07
585	000011	深物业 A	8,100	129,600.00	0.07
586	000507	珠海港	24,700	129,428.00	0.07
587	600531	豫光金铅	33,000	129,360.00	0.07
588	300039	上海凯宝	24,000	129,360.00	0.07
589	300783	三只松鼠	1,700	129,166.00	0.07
590	603068	博通集成	1,600	128,928.00	0.07
591	000918	嘉凯城	27,400	128,780.00	0.07
592	300684	中石科技	3,700	128,390.00	0.07
593	300559	佳发教育	6,050	128,381.00	0.07
594	002067	景兴纸业	42,200	128,288.00	0.07
595	300487	蓝晓科技	3,900	128,232.00	0.07
596	002726	龙大肉食	15,171	128,043.24	0.07

597	002322	理工环科	10,700	127,544.00	0.07
598	300366	创意信息	14,000	127,400.00	0.07
599	300531	优博讯	6,100	126,880.00	0.07
600	600217	中再资环	26,300	126,766.00	0.07
601	002880	卫光生物	1,900	126,692.00	0.07
602	300114	中航电测	11,100	126,651.00	0.07
603	002303	美盈森	29,100	126,585.00	0.07
604	002204	大连重工	29,400	126,420.00	0.07
605	002461	珠江啤酒	12,600	126,252.00	0.07
606	300311	任子行	17,905	126,230.25	0.07
607	600775	南京熊猫	15,400	126,126.00	0.07
608	300527	中船应急	13,835	125,483.45	0.07
609	002792	通宇通讯	5,100	125,358.00	0.07
610	300785	值得买	997	125,332.87	0.07
611	002031	巨轮智能	67,000	125,290.00	0.07
612	002343	慈文传媒	14,420	125,165.60	0.07
613	300726	宏达电子	4,500	125,145.00	0.07
614	601001	大同煤业	31,900	125,048.00	0.07
615	600075	新疆天业	25,700	124,645.00	0.07
616	002358	森源电气	24,800	123,752.00	0.07
617	002215	诺普信	20,800	123,552.00	0.07
618	300603	立昂技术	4,200	123,186.00	0.07
619	600495	晋西车轴	32,025	122,976.00	0.07
620	600825	新华传媒	19,800	122,958.00	0.07
621	002017	东信和平	10,300	122,776.00	0.07
622	603660	苏州科达	13,372	122,621.24	0.07
623	603305	旭升股份	3,202	122,572.56	0.07
624	600123	兰花科创	26,000	122,460.00	0.07
625	603012	创力集团	17,100	121,923.00	0.07
626	300198	纳川股份	31,500	121,905.00	0.07
627	002307	北新路桥	20,440	121,822.40	0.07
628	002947	恒铭达	1,900	121,600.00	0.07
629	600963	岳阳林纸	34,250	121,587.50	0.07
630	603383	顶点软件	2,720	121,284.80	0.07
631	002462	嘉事堂	8,900	121,218.00	0.07
632	300336	新文化	24,600	121,032.00	0.07
633	600571	信雅达	13,300	120,897.00	0.07
634	600020	中原高速	34,100	120,714.00	0.07
635	300102	乾照光电	26,800	120,600.00	0.07
636	603313	梦百合	5,120	120,473.60	0.07
637	300081	恒信东方	14,100	120,132.00	0.07
638	601116	三江购物	8,400	120,036.00	0.07
639	002166	莱茵生物	15,120	119,901.60	0.07

640	600133	东湖高新	21,200	119,780.00	0.07
641	601366	利群股份	19,600	119,756.00	0.07
642	002930	宏川智慧	8,498	119,566.86	0.07
643	002510	天汽模	28,000	119,280.00	0.07
644	603688	石英股份	5,000	119,100.00	0.07
645	300388	国祯环保	12,900	118,938.00	0.07
646	300409	道氏技术	10,600	118,932.00	0.07
647	600708	光明地产	42,304	118,874.24	0.06
648	300423	鲁亿通	9,600	118,656.00	0.06
649	603267	鸿远电子	2,740	118,505.00	0.06
650	002746	仙坛股份	8,915	118,123.75	0.06
651	300065	海兰信	12,000	118,080.00	0.06
652	000882	华联股份	62,400	117,936.00	0.06
653	300393	中来股份	17,628	117,755.04	0.06
654	600261	阳光照明	33,000	117,150.00	0.06
655	300066	三川智慧	23,800	117,096.00	0.06
656	300332	天壕环境	26,700	116,679.00	0.06
657	002224	三力士	19,300	116,572.00	0.06
658	300302	同有科技	9,200	116,564.00	0.06
659	002314	南山控股	31,000	116,560.00	0.06
660	000957	中通客车	17,900	116,529.00	0.06
661	000802	北京文化	19,000	116,470.00	0.06
662	002158	汉钟精机	8,200	116,030.00	0.06
663	000040	东旭蓝天	39,400	115,836.00	0.06
664	300368	汇金股份	12,000	115,800.00	0.06
665	300571	平治信息	2,500	115,500.00	0.06
666	000557	西部创业	33,200	115,204.00	0.06
667	002614	奥佳华	10,500	115,185.00	0.06
668	300091	金通灵	32,580	115,007.40	0.06
669	000639	西王食品	20,460	114,371.40	0.06
670	000797	中国武夷	29,929	114,328.78	0.06
671	600626	申达股份	22,700	113,727.00	0.06
672	300043	星辉娱乐	28,400	113,600.00	0.06
673	603803	瑞斯康达	9,700	113,296.00	0.06
674	600343	航天动力	14,600	113,296.00	0.06
675	300006	莱美药业	21,600	113,184.00	0.06
676	601700	风范股份	21,500	113,090.00	0.06
677	603979	金诚信	10,962	113,018.22	0.06
678	000935	四川双马	8,800	112,992.00	0.06
679	300323	华灿光电	20,700	112,815.00	0.06
680	000996	中国中期	13,050	112,752.00	0.06
681	603008	喜临门	10,500	112,665.00	0.06
682	000968	蓝焰控股	14,700	112,455.00	0.06

683	600681	百川能源	21,960	112,435.20	0.06
684	600759	洲际油气	60,400	112,344.00	0.06
685	600894	广日股份	16,400	112,340.00	0.06
686	603220	中贝通信	6,400	112,000.00	0.06
687	601606	长城军工	8,300	111,884.00	0.06
688	300191	潜能恒信	6,000	111,840.00	0.06
689	600997	开滦股份	24,300	111,780.00	0.06
690	002677	浙江美大	9,900	111,672.00	0.06
691	603367	辰欣药业	6,900	111,573.00	0.06
692	601126	四方股份	18,400	111,320.00	0.06
693	300773	拉卡拉	3,200	111,264.00	0.06
694	002518	科士达	8,970	111,228.00	0.06
695	600331	宏达股份	53,900	111,034.00	0.06
696	300788	中信出版	2,300	110,837.00	0.06
697	000751	锌业股份	42,900	110,682.00	0.06
698	600773	西藏城投	18,600	110,484.00	0.06
699	603508	思维列控	3,280	110,339.20	0.06
700	000958	东方能源	26,500	110,240.00	0.06
701	300110	华仁药业	26,860	110,126.00	0.06
702	300096	易联众	13,000	110,110.00	0.06
703	300579	数字认证	2,700	109,971.00	0.06
704	603801	志邦家居	4,120	109,962.80	0.06
705	603626	科森科技	9,040	109,836.00	0.06
706	600987	航民股份	20,465	109,487.75	0.06
707	603337	杰克股份	4,995	109,390.50	0.06
708	002206	海利得	32,450	109,356.50	0.06
709	601949	中国出版	20,800	109,200.00	0.06
710	002309	中利集团	19,800	108,900.00	0.06
711	002663	普邦股份	47,700	108,756.00	0.06
712	300740	御家汇	7,900	108,704.00	0.06
713	300300	汉鼎宇佑	17,950	108,597.50	0.06
714	300533	冰川网络	3,000	108,540.00	0.06
715	601330	绿色动力	11,400	108,300.00	0.06
716	002443	金洲管道	15,900	108,279.00	0.06
717	002061	浙江交科	20,900	108,262.00	0.06
718	000925	众合科技	14,820	108,037.80	0.06
719	603399	吉翔股份	14,500	107,590.00	0.06
720	002335	科华恒盛	5,100	107,559.00	0.06
721	300276	三丰智能	21,740	107,395.60	0.06
722	300776	帝尔激光	1,280	107,238.40	0.06
723	000811	冰轮环境	17,100	107,046.00	0.06
724	000666	经纬纺机	11,800	106,908.00	0.06
725	600981	汇鸿集团	34,000	106,760.00	0.06

726	002913	奥士康	1,800	106,704.00	0.06
727	002228	合兴包装	26,600	106,666.00	0.06
728	300504	天邑股份	3,900	106,470.00	0.06
729	600590	泰豪科技	19,710	106,236.90	0.06
730	002519	银河电子	25,580	106,157.00	0.06
731	601789	宁波建工	22,300	106,148.00	0.06
732	603869	新智认知	9,700	105,439.00	0.06
733	300765	新诺威	4,660	105,036.40	0.06
734	600971	恒源煤电	22,900	104,653.00	0.06
735	002619	艾格拉斯	42,080	104,358.40	0.06
736	600351	亚宝药业	20,500	104,345.00	0.06
737	300570	太辰光	5,200	104,000.00	0.06
738	002267	陕天然气	17,000	103,870.00	0.06
739	300252	金信诺	10,850	103,834.50	0.06
740	600096	云天化	21,800	103,550.00	0.06
741	002776	柏堡龙	12,150	103,518.00	0.06
742	002274	华昌化工	21,700	103,509.00	0.06
743	002756	永兴材料	5,400	103,086.00	0.06
744	300205	天喻信息	9,900	102,960.00	0.06
745	002218	拓日新能	28,200	102,930.00	0.06
746	603927	中科软	1,700	102,748.00	0.06
747	002344	海宁皮城	24,500	102,655.00	0.06
748	300213	佳讯飞鸿	15,900	102,555.00	0.06
749	002433	太安堂	23,400	102,492.00	0.06
750	600389	江山股份	5,600	102,424.00	0.06
751	300255	常山药业	17,700	102,129.00	0.06
752	600162	香江控股	51,700	101,849.00	0.06
753	601886	江河集团	17,700	101,775.00	0.06
754	002029	七匹狼	20,100	101,706.00	0.06
755	300204	舒泰神	9,100	101,556.00	0.06
756	603458	勘设股份	4,865	101,192.00	0.06
757	002245	澳洋顺昌	26,000	100,620.00	0.06
758	000019	深粮控股	12,500	100,500.00	0.05
759	002664	长鹰信质	7,600	100,472.00	0.05
760	603919	金徽酒	5,770	100,340.30	0.05
761	603359	东珠生态	5,980	100,045.40	0.05
762	300634	彩讯股份	4,500	100,035.00	0.05
763	002796	世嘉科技	4,700	99,405.00	0.05
764	002243	通产丽星	6,900	99,360.00	0.05
765	002636	金安国纪	10,900	99,299.00	0.05
766	600458	时代新材	15,300	99,144.00	0.05
767	002137	麦达数字	13,100	99,036.00	0.05
768	300762	上海瀚讯	3,100	98,890.00	0.05

769	000950	重药控股	19,600	98,784.00	0.05
770	600548	深 高 速	10,800	98,712.00	0.05
771	600229	城市传媒	13,300	98,686.00	0.05
772	002833	弘亚数控	4,020	98,610.60	0.05
773	002840	华统股份	5,200	98,488.00	0.05
774	002482	广田集团	29,200	97,820.00	0.05
775	000550	江铃汽车	7,900	97,723.00	0.05
776	000520	长航凤凰	26,900	97,647.00	0.05
777	603595	东尼电子	3,028	97,501.60	0.05
778	002167	东方锆业	18,800	97,196.00	0.05
779	000665	湖北广电	18,560	97,068.80	0.05
780	603590	康辰药业	2,500	96,900.00	0.05
781	000038	深 大 通	7,960	96,714.00	0.05
782	300378	鼎捷软件	7,100	96,560.00	0.05
783	000544	中原环保	14,800	96,348.00	0.05
784	600035	楚天高速	32,000	96,320.00	0.05
785	002229	鸿博股份	13,200	96,228.00	0.05
786	600995	文山电力	12,700	95,504.00	0.05
787	603360	百傲化学	4,900	95,207.00	0.05
788	002095	生 意 宝	4,700	94,940.00	0.05
789	300365	恒华科技	9,300	94,860.00	0.05
790	600090	*ST 济堂	32,700	94,830.00	0.05
791	600184	光电股份	9,800	94,472.00	0.05
792	000532	华金资本	7,900	94,326.00	0.05
793	000928	中钢国际	24,000	94,320.00	0.05
794	300439	美康生物	5,200	93,964.00	0.05
795	000567	海德股份	7,300	93,878.00	0.05
796	603730	岱美股份	2,900	93,525.00	0.05
797	601515	东风股份	15,300	93,483.00	0.05
798	300061	旗天科技	15,500	93,465.00	0.05
799	600810	神马股份	13,080	93,260.40	0.05
800	002542	中化岩土	27,400	93,160.00	0.05
801	601900	南方传媒	10,300	93,112.00	0.05
802	002060	粤 水 电	32,100	92,769.00	0.05
803	603980	吉华集团	13,280	92,561.60	0.05
804	000889	中嘉博创	10,300	92,391.00	0.05
805	002929	润建股份	3,200	92,128.00	0.05
806	002564	天沃科技	23,200	91,640.00	0.05
807	000620	新 华 联	28,900	91,613.00	0.05
808	300682	朗新科技	5,350	91,057.00	0.05
809	002685	华东重机	15,400	90,860.00	0.05
810	000584	哈工智能	16,400	90,692.00	0.05
811	603587	地素时尚	5,380	90,653.00	0.05

812	600933	爱柯迪	6,500	90,480.00	0.05
813	603612	索通发展	7,920	90,446.40	0.05
814	002562	兄弟科技	17,220	90,405.00	0.05
815	600603	广汇物流	19,100	89,961.00	0.05
816	600136	当代文体	11,000	89,760.00	0.05
817	002355	兴民智通	16,600	89,640.00	0.05
818	300288	朗玛信息	7,700	89,551.00	0.05
819	603959	百利科技	10,160	89,408.00	0.05
820	300148	天舟文化	22,530	89,218.80	0.05
821	300208	青岛中程	14,200	89,176.00	0.05
822	000815	美利云	13,200	89,100.00	0.05
823	600581	八一钢铁	29,200	89,060.00	0.05
824	300215	电科院	14,400	88,992.00	0.05
825	300140	中环装备	9,900	88,902.00	0.05
826	600800	天津磁卡	19,000	88,730.00	0.05
827	600569	安阳钢铁	43,700	88,711.00	0.05
828	002305	南国置业	32,600	88,672.00	0.05
829	002393	力生制药	3,360	88,603.20	0.05
830	600076	康欣新材	27,500	88,550.00	0.05
831	300510	金冠股份	20,099	88,435.60	0.05
832	000615	京汉股份	20,800	88,400.00	0.05
833	600533	栖霞建设	24,100	88,206.00	0.05
834	000058	深赛格	11,200	88,032.00	0.05
835	600322	天房发展	33,500	87,435.00	0.05
836	002478	常宝股份	18,100	87,423.00	0.05
837	600691	阳煤化工	45,300	86,976.00	0.05
838	000525	红太阳	10,900	86,546.00	0.05
839	603357	设计总院	8,740	86,526.00	0.05
840	600710	苏美达	19,800	85,932.00	0.05
841	002516	旷达科技	27,900	85,932.00	0.05
842	600929	湖南盐业	13,900	85,763.00	0.05
843	603777	来伊份	5,080	85,445.60	0.05
844	300424	航新科技	6,355	85,029.90	0.05
845	000065	北方国际	11,575	84,613.25	0.05
846	601595	上海电影	5,600	84,448.00	0.05
847	603105	芯能科技	9,600	84,384.00	0.05
848	002741	光华科技	7,100	83,780.00	0.05
849	601107	四川成渝	24,700	83,733.00	0.05
850	603466	风语筑	4,300	83,721.00	0.05
851	300237	美晨生态	38,760	83,334.00	0.05
852	600467	好当家	33,200	83,332.00	0.05
853	000498	山东路桥	17,100	82,935.00	0.05
854	603728	鸣志电器	6,334	82,595.36	0.05

855	002284	亚太股份	16,900	82,472.00	0.05
856	300723	一品红	1,900	81,871.00	0.04
857	601858	中国科传	9,100	81,809.00	0.04
858	300673	佩蒂股份	2,100	81,648.00	0.04
859	002015	协鑫能科	15,500	81,530.00	0.04
860	000561	烽火电子	11,400	81,054.00	0.04
861	600965	福成股份	12,400	80,724.00	0.04
862	600054	黄山旅游	9,900	80,487.00	0.04
863	600798	宁波海运	27,500	80,300.00	0.04
864	603610	麒盛科技	2,500	80,200.00	0.04
865	600230	沧州大化	9,480	80,106.00	0.04
866	002464	众应互联	13,916	79,877.84	0.04
867	000657	中钨高新	13,360	79,625.60	0.04
868	603421	鼎信通讯	5,300	79,394.00	0.04
869	002538	司尔特	16,500	79,365.00	0.04
870	002246	北化股份	10,600	79,288.00	0.04
871	300021	大禹节水	18,050	79,239.50	0.04
872	002631	德尔未来	10,300	79,104.00	0.04
873	601020	华钰矿业	10,100	78,780.00	0.04
874	300768	迪普科技	1,700	78,693.00	0.04
875	600897	厦门空港	4,388	78,589.08	0.04
876	603896	寿仙谷	2,300	77,924.00	0.04
877	002955	鸿合科技	2,560	77,824.00	0.04
878	002751	易尚展示	3,400	77,248.00	0.04
879	300793	佳禾智能	2,900	77,140.00	0.04
880	000881	中广核技	10,600	76,956.00	0.04
881	002621	美吉姆	12,520	76,872.80	0.04
882	002232	启明信息	7,800	76,518.00	0.04
883	002662	京威股份	22,900	76,486.00	0.04
884	603727	博迈科	4,300	76,325.00	0.04
885	002712	思美传媒	10,900	76,191.00	0.04
886	600278	东方创业	8,200	76,014.00	0.04
887	000885	城发环境	7,600	75,924.00	0.04
888	600715	文投控股	28,200	75,294.00	0.04
889	603579	荣泰健康	2,800	75,096.00	0.04
890	300011	鼎汉技术	12,700	74,549.00	0.04
891	002646	青青稞酒	6,800	74,324.00	0.04
892	000576	广东甘化	10,200	74,154.00	0.04
893	300771	智莱科技	1,940	73,332.00	0.04
894	300309	吉艾科技	20,180	72,244.40	0.04
895	603299	苏盐井神	11,700	72,189.00	0.04
896	603618	杭电股份	13,100	72,050.00	0.04
897	300109	新开源	4,818	71,354.58	0.04

898	000150	宜华健康	19,944	71,000.64	0.04
899	000821	京山轻机	12,200	70,760.00	0.04
900	603063	禾望电气	9,900	70,488.00	0.04
901	002101	广东鸿图	10,250	70,417.50	0.04
902	300799	左江科技	800	69,744.00	0.04
903	002435	长江健康	18,700	69,003.00	0.04
904	000822	山东海化	20,400	68,952.00	0.04
905	002345	潮宏基	20,600	68,598.00	0.04
906	000965	天保基建	21,100	68,575.00	0.04
907	601015	陕西黑猫	24,660	67,321.80	0.04
908	600242	*ST 中昌	10,600	67,310.00	0.04
909	300520	科大国创	3,640	67,303.60	0.04
910	603169	兰石重装	16,100	67,298.00	0.04
911	603876	鼎胜新材	4,900	66,885.00	0.04
912	002933	新兴装备	1,900	66,671.00	0.04
913	600758	辽宁能源	20,000	66,600.00	0.04
914	002141	贤丰控股	21,600	66,528.00	0.04
915	002962	五方光电	2,700	65,961.00	0.04
916	601101	昊华能源	18,100	65,703.00	0.04
917	603348	文灿股份	3,400	64,974.00	0.04
918	300307	慈星股份	15,300	64,872.00	0.04
919	603808	歌力思	5,000	64,400.00	0.04
920	000791	甘肃电投	20,640	63,777.60	0.03
921	000662	*ST 天夏	25,700	63,736.00	0.03
922	002782	可立克	4,800	63,408.00	0.03
923	002638	*ST 勤上	30,100	63,210.00	0.03
924	002960	青鸟消防	2,700	62,964.00	0.03
925	600207	安彩高科	13,100	62,749.00	0.03
926	002590	万安科技	9,200	62,652.00	0.03
927	603093	南华期货	2,900	62,466.00	0.03
928	300506	名家汇	12,410	62,298.20	0.03
929	300800	力合科技	1,900	62,054.00	0.03
930	300176	鸿特科技	11,640	61,924.80	0.03
931	000905	厦门港务	9,600	61,920.00	0.03
932	000923	河钢资源	4,900	61,740.00	0.03
933	603648	畅联股份	7,000	61,600.00	0.03
934	300777	中简科技	1,700	61,540.00	0.03
935	002852	道道全	4,240	61,140.80	0.03
936	600618	氯碱化工	8,600	61,060.00	0.03
937	600686	金龙汽车	10,800	60,912.00	0.03
938	600876	洛阳玻璃	4,500	60,885.00	0.03
939	002016	世荣兆业	9,300	60,822.00	0.03
940	600310	桂东电力	15,800	60,672.00	0.03

941	300262	巴安水务	15,350	60,632.50	0.03
942	600738	兰州民百	11,700	60,489.00	0.03
943	603711	香飘飘	2,000	60,220.00	0.03
944	002451	摩恩电气	8,400	59,556.00	0.03
945	000517	荣安地产	24,300	59,535.00	0.03
946	600226	*ST 瀚叶	24,994	58,735.90	0.03
947	603318	派思股份	7,700	58,520.00	0.03
948	300107	建新股份	10,600	58,088.00	0.03
949	002370	亚太药业	12,200	58,072.00	0.03
950	603693	江苏新能	4,600	57,316.00	0.03
951	001896	豫能控股	17,600	56,672.00	0.03
952	002378	章源钨业	14,000	56,560.00	0.03
953	000056	皇庭国际	14,200	56,232.00	0.03
954	603839	安正时尚	4,420	56,134.00	0.03
955	603619	中曼石油	4,500	55,755.00	0.03
956	002651	利君股份	11,500	55,660.00	0.03
957	300127	银河磁体	3,500	55,475.00	0.03
958	002895	川恒股份	4,500	55,080.00	0.03
959	603180	金牌厨柜	1,160	54,728.80	0.03
960	002377	国创高新	13,900	54,349.00	0.03
961	600295	鄂尔多斯	7,700	54,285.00	0.03
962	603327	福蓉科技	2,100	54,243.00	0.03
963	600283	钱江水利	5,259	54,115.11	0.03
964	002906	华阳集团	3,400	52,666.00	0.03
965	002961	瑞达期货	1,900	52,535.00	0.03
966	603915	国茂股份	3,400	52,258.00	0.03
967	603053	成都燃气	3,600	51,444.00	0.03
968	603390	通达电气	3,900	51,012.00	0.03
969	000626	远大控股	8,300	50,547.00	0.03
970	000711	京蓝科技	15,640	49,891.60	0.03
971	000514	渝开发	12,800	48,896.00	0.03
972	002346	柘中股份	4,900	48,167.00	0.03
973	603530	神马电力	1,700	48,127.00	0.03
974	603557	起步股份	5,300	47,011.00	0.03
975	300428	四通新材	3,100	46,872.00	0.03
976	601619	嘉泽新能	15,800	46,136.00	0.03
977	603103	横店影视	2,920	46,136.00	0.03
978	603603	博天环境	6,300	43,470.00	0.02
979	603733	仙鹤股份	2,700	43,389.00	0.02
980	300775	三角防务	2,000	43,280.00	0.02
981	002973	侨银环保	1,800	42,192.00	0.02
982	603815	交建股份	2,000	41,700.00	0.02
983	300805	电声股份	1,800	41,256.00	0.02

984	603997	继峰股份	5,800	39,846.00	0.02
985	603956	威派格	2,400	39,528.00	0.02
986	002759	天际股份	6,100	38,979.00	0.02
987	603013	亚普股份	2,400	38,688.00	0.02
988	002907	华森制药	2,200	38,522.00	0.02
989	002911	佛燃能源	2,400	36,480.00	0.02
990	603279	景津环保	1,700	34,833.00	0.02
991	002951	金时科技	1,900	33,820.00	0.02
992	603081	大丰实业	2,900	32,741.00	0.02
993	002485	希努尔	6,200	30,752.00	0.02
994	002969	嘉美包装	3,900	29,757.00	0.02
995	603551	奥普家居	1,800	29,214.00	0.02
996	603687	大胜达	2,100	28,917.00	0.02
997	603848	好太太	2,100	28,665.00	0.02
998	603992	松霖科技	1,700	27,132.00	0.01
999	603676	卫信康	2,500	27,025.00	0.01
1,000	300798	锦鸡股份	1,800	24,750.00	0.01

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688222	成都先导	5,334	233,095.80	0.13
2	688090	瑞松科技	3,013	179,122.85	0.10
3	688568	中科星图	6,474	104,943.54	0.06
4	688027	N 国盾	1,934	69,972.12	0.04
5	688600	皖仪科技	4,283	66,386.50	0.04
6	603087	甘李药业	430	43,129.00	0.02
7	600069	*ST 银鸽	36,500	33,580.00	0.02
8	600734	*ST 实达	13,200	29,040.00	0.02
9	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
10	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
12	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
13	300847	N 中船	1,421	9,861.74	0.01
14	600175	退市美都	27,600	9,108.00	0.00
15	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
16	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
17	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
18	605166	聚合顺	41	649.85	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300661	圣邦股份	2,393,135.00	1.20
2	002185	华天科技	1,881,434.00	0.94
3	300450	先导智能	1,674,869.00	0.84
4	002405	四维图新	1,618,615.38	0.81
5	300223	北京君正	1,614,602.11	0.81
6	300747	锐科激光	1,466,932.00	0.74
7	300725	药石科技	1,400,875.10	0.70
8	300357	我武生物	1,385,609.52	0.70
9	300676	华大基因	1,321,739.10	0.66
10	300226	上海钢联	1,245,761.00	0.63
11	300685	艾德生物	1,244,846.00	0.63
12	300558	贝达药业	1,190,685.00	0.60
13	300463	迈克生物	1,186,889.00	0.60
14	300567	精测电子	1,141,451.00	0.57
15	300326	凯利泰	1,130,220.08	0.57
16	300212	易华录	1,119,493.80	0.56
17	300271	华宇软件	1,104,325.00	0.55
18	300630	普利制药	1,035,847.00	0.52
19	300616	尚品宅配	1,035,162.00	0.52
20	002436	兴森科技	1,028,488.00	0.52

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

7.4.2 累计买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	002185	华天科技	3,192,364.39	1.60
2	300450	先导智能	2,845,719.68	1.43
3	002405	四维图新	2,787,336.97	1.40
4	300661	圣邦股份	2,669,670.00	1.34
5	300357	我武生物	2,321,282.20	1.17
6	300558	贝达药业	2,287,088.88	1.15
7	300212	易华录	1,969,730.00	0.99
8	300271	华宇软件	1,914,064.29	0.96
9	300482	万孚生物	1,703,338.58	0.86
10	002138	顺络电子	1,688,097.93	0.85
11	688111	金山办公	1,664,170.05	0.84

12	300223	北京君正	1,655,677.98	0.83
13	300782	卓胜微	1,655,232.00	0.83
14	300496	中科创达	1,613,911.00	0.81
15	002396	星网锐捷	1,607,642.00	0.81
16	300630	普利制药	1,536,029.73	0.77
17	300676	华大基因	1,529,115.00	0.77
18	002156	通富微电	1,511,419.00	0.76
19	300725	药石科技	1,497,066.00	0.75
20	300595	欧普康视	1,484,735.60	0.75

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	285,331,187.81
卖出股票收入（成交）总额	299,126,691.90

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	88,800.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	88,800.00	0.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127017	万青转债	254	25,400.00	0.01
2	128110	永兴转债	198	19,800.00	0.01

3	123053	宝通转债	166	16,600.00	0.01
4	113586	上机转债	140	14,000.00	0.01
5	113588	润达转债	130	13,000.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2007	IC2007	4	4,639,520.00	182,430.00	-
公允价值变动总额合计（元）					182,430.00
股指期货投资本期收益（元）					398,116.50
股指期货投资本期公允价值变动（元）					108,100.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	640,277.17
2	应收证券清算款	603,345.76
3	应收股利	-
4	应收利息	832.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,244,455.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688222	成都先导	233,095.80	0.13	科创板新股锁定期
2	688090	瑞松科技	179,122.85	0.10	科创板新股锁定期
3	688568	中科星图	104,943.54	0.06	新股未上市
4	688027	国盾量子	69,972.12	0.04	新股未上市
5	688600	皖仪科技	66,386.50	0.04	新股未上市

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,901	56,111.77	44,485,400.00	20.32%	174,406,600.00	79.68%

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	招商证券股份有限公司	8,776,600.00	4.01%
2	国寿养老配置 8 号混合型养老金产品-中国工商银行股份有限公司	6,671,200.00	3.05%
3	颜飞	6,413,300.00	2.93%
4	广发证券股份有限公司	6,230,900.00	2.85%
5	中国国际金融股份有限公司	5,197,245.00	2.37%
6	徐洁静	5,050,100.00	2.31%
7	杨肖	4,621,400.00	2.11%
8	中国银河证券股份有限公司	4,491,900.00	2.05%
9	方正证券股份有限公司	4,395,255.00	2.01%
10	深圳霖润投资控股有限公司-霖润价值一号私募投资基金	2,877,800.00	1.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年9月29日)基金份额总额	587,892,000.00
本报告期期初基金份额总额	278,892,000.00
本报告期基金总申购份额	333,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	393,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	218,892,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	1	389,892,322.16	67.12%	38,990.07	67.12%	-
华泰证券	4	166,596,660.33	28.68%	16,661.03	28.68%	-
国信证券	1	24,361,716.55	4.19%	2,436.61	4.19%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
万联证券	200,249.36	39.02%	-	-	-	-
华泰证券	49,922.96	9.73%	-	-	-	-

国信证券	263,086.60	51.26%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 调整申赎结算模式的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
3	南方基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
4	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 调整指数使用费的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-02-26
5	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分基金新增扩位证券简称的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16
6	关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金调整指数使用费的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-25
7	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（华南）为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-28
8	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-05
9	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-08
10	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-09

§ 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	20200605-20200608	14,130,300.00	244,330,300.00	253,263,355.00	5,197,245.00	2.37%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>