

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

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 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 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	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	65
9 开放式基金份额变动	65
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	70
11 影响投资者决策的其他重要信息	71
12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金	
基金简称	广发中证 1000 指数	
基金主代码	006486	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	59,337,191.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
下属分级基金的交易代码	006486	006487
报告期末下属分级基金的份额总额	29,672,668.14 份	29,664,523.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，有效跟踪中证 1000 指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。</p> <p>本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的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将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。</p> <p>对无法严格按照标的指数进行复制的情况，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，优化确定投资组合中的个股权重，以获得更接近标的指数的收益率。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	广发基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105828	95588	
传真	020-89899158	010-66105798	
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55 号	
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号	
邮政编码	510308	100140	
法定代表人	孙树明	陈四清	

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广 场南塔 31-33 楼

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（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
本期已实现收益	1,237,603.21	847,089.27
本期利润	3,148,302.78	2,873,531.37
加权平均基金份额本期利润	0.1128	0.1164
本期加权平均净值利润率	8.13%	8.46%
本期基金份额净值增长率	6.88%	6.67%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
期末可供分配利润	7,131,900.70	6,864,869.69
期末可供分配基金份额利润	0.2404	0.2314
期末基金资产净值	44,908,941.38	44,623,373.69
期末基金份额净值	1.5135	1.5043
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
基金份额累计净值增长率	51.35%	50.43%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证 1000 指数 A

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	4.01%	0.97%	3.76%	0.97%	0.25%	0.00%
过去三个月	12.51%	0.84%	11.91%	0.84%	0.60%	0.00%
过去六个月	6.88%	1.08%	6.29%	1.10%	0.59%	-0.02%
过去一年	12.04%	1.30%	11.60%	1.32%	0.44%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.35%	1.42%	56.90%	1.48%	-5.55%	-0.06%

广发中证 1000 指数 C

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	3.98%	0.97%	3.76%	0.97%	0.22%	0.00%
过去三个月	12.40%	0.84%	11.91%	0.84%	0.49%	0.00%
过去六个月	6.67%	1.08%	6.29%	1.10%	0.38%	-0.02%
过去一年	11.59%	1.30%	11.60%	1.32%	-0.01%	-0.02%
自基金合同生效起至今	50.43%	1.42%	56.90%	1.48%	-6.47%	-0.06%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金
 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
 （2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日）

广发中证 1000 指数 A



广发中证 1000 指数 C



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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆志明	本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发中证	2021-06-17	-	22 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基

	<p>全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理</p>			<p>金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、量化投资部副总经理、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至</p>
--	--	--	--	---

					<p>2021 年 2 月 10 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 日)。</p>
罗国庆	本基金的基金经理；广发中证医疗指数证券投资	2018-11-02	2021-06-17	12 年	<p>罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券基金业从业证书。曾任深圳证券信息</p>

	<p>基金 (LOF) 的基金经理; 广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 指数投资部副总经理</p>				<p>有限公司研究员, 华富基金管理有限公司产品设计研究员, 广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)。</p>
--	---	--	--	--	--

注: 1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 13 次，其中 7 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的是中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

2021 年上半年，A 股市场出现小幅上涨，中证全指上涨 3.78%。上半年小市值股票出现反弹，中证 1000 指数上涨 6.58%，尤其在 2 季度作为小市值股票代表的中证 1000 指数大幅跑赢整体市场。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 6.88%，C 类基金份额净值增长率为 6.67%，同期业绩比较基准收益率为 6.29%。

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，疫情仍是影响全球经济复苏节奏的重要因素。短期来看，变异毒株是未来防疫工作开展中的巨大挑战。

当前，市场最大的担忧在于美联储货币政策转向及央行流动性收紧导致高估值板块的估值下杀。诚然，我们认为流动性指标的确需要保持监控，但同时一些新兴产业带来的战略性投资机会更值得投资者关注。例如，以碳中和相关政策作为催化的能源产业革新可能带来的光伏、新能源车等板块的发展机会。此外，我国人口结构也走向拐点，未来新一代所推崇的线上便捷式多元消费领域以及人口老龄化所带来的养老板块的投资机会也值得关注。

在市场风格方面，预计下半年作为小市值股票代表的中证 1000 指数或将会保持一定的相对优势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

益为准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 1000 指数型发起式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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,054,915.52	3,814,715.15
结算备付金		-	20,842.73
存出保证金		15,087.33	8,656.13
交易性金融资产	6.4.7.2	83,291,653.29	50,436,212.98
其中：股票投资		83,291,653.29	50,436,212.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	767.89	369.55
应收股利		-	-
应收申购款		916,635.30	120,390.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		92,279,059.33	54,401,187.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		957,226.47	-
应付赎回款		1,627,037.02	682,971.06
应付管理人报酬		32,265.41	22,732.73
应付托管费		6,453.08	4,546.56
应付销售服务费		11,603.83	6,413.02
应付交易费用	6.4.7.7	50,090.18	18,995.15
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	62,068.27	107,500.00
负债合计		2,746,744.26	843,158.52
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	59,337,191.87	37,877,796.76
未分配利润	6.4.7.10	30,195,123.20	15,680,231.81
所有者权益合计		89,532,315.07	53,558,028.57
负债和所有者权益总计		92,279,059.33	54,401,187.09

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发中证 1000 指数 A 基金份额净值人民币 1.5135 元，基金份额总额 29,672,668.14 份；广发中证 1000 指数 C 基金份额净值人民币 1.5043 元，基金份额总额 29,664,523.73 份；总份额总额 59,337,191.87 份。

6.2 利润表

会计主体：广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		6,549,617.11	6,508,626.62
1.利息收入		10,568.15	10,481.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,568.15	10,481.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,512,560.91	3,704,383.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,031,549.94	3,432,852.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	481,010.97	271,531.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,937,141.67	2,755,725.99

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	89,346.38	38,035.34
减：二、费用		527,782.96	331,645.71
1. 管理人报酬		178,744.77	107,020.54
2. 托管费		35,748.91	21,404.11
3. 销售服务费		66,878.56	27,176.86
4. 交易费用	6.4.7.18	172,882.63	121,358.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	73,528.09	54,685.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,021,834.15	6,176,980.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,021,834.15	6,176,980.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	37,877,796.76	15,680,231.81	53,558,028.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,021,834.15	6,021,834.15
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）	21,459,395.11	8,493,057.24	29,952,452.35
其中：1. 基金申购款	98,213,888.20	38,010,899.76	136,224,787.96
2. 基金赎回款	-76,754,493.09	-29,517,842.52	-106,272,335.61
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）	59,337,191.87	30,195,123.20	89,532,315.07
项目	上年度可比期间 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）	36,468,894.84	6,403,724.27	42,872,619.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,176,980.91	6,176,980.91
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）	-3,672,904.81	-1,099,885.33	-4,772,790.14
其中：1.基金申购款	40,761,636.13	9,541,418.57	50,303,054.70
2.基金赎回款	-44,434,540.94	-10,641,303.90	-55,075,844.84
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）	32,795,990.03	11,480,819.85	44,276,809.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2018]798 号《关于准予广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2018 年 9 月 25 日向社会公开发行募集并于 2018 年 11 月 2 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 9 月 25 日至 2018 年 10 月 26 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 19,676,167.43 元，有效认购户数为 971 户。其中广发中证 1000 指数 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 14,264,655.44 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 1,223.57 元；广发中证 1000 指数 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 5,409,779.19 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 509.23 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明

会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	8,054,915.52
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	8,054,915.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	75,738,378.25	83,291,653.29	7,553,275.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	75,738,378.25	83,291,653.29	7,553,275.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	761.77
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	6.12
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	767.89

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	50,090.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	50,090.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	52,068.27

应付指数使用费	10,000.00
合计	62,068.27

6.4.7.9 实收基金

广发中证 1000 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,168,322.52	24,168,322.52
本期申购	24,759,121.60	24,759,121.60
本期赎回（以“-”号填列）	-19,254,775.98	-19,254,775.98
本期末	29,672,668.14	29,672,668.14

广发中证 1000 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,709,474.24	13,709,474.24
本期申购	73,454,766.60	73,454,766.60
本期赎回（以“-”号填列）	-57,499,717.11	-57,499,717.11
本期末	29,664,523.73	29,664,523.73

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

广发中证 1000 指数 A

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	4,740,009.51	5,316,187.29	10,056,196.80
本期利润	1,237,603.21	1,910,699.57	3,148,302.78
本期基金份额交易产生的变动数	1,154,287.98	877,485.68	2,031,773.66
其中：基金申购款	5,153,737.68	4,295,325.27	9,449,062.95
基金赎回款	-3,999,449.70	-3,417,839.59	-7,417,289.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,131,900.70	8,104,372.54	15,236,273.24

广发中证 1000 指数 C

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	2,606,659.90	3,017,375.11	5,624,035.01
本期利润	847,089.27	2,026,442.10	2,873,531.37
本期基金份额交易产生的变动数	3,411,120.52	3,050,163.06	6,461,283.58
其中：基金申购款	14,995,142.48	13,566,694.33	28,561,836.81
基金赎回款	-11,584,021.96	-10,516,531.27	-22,100,553.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,864,869.69	8,093,980.27	14,958,849.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,678.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	97.67
结算备付金利息收入	791.63
其他	-
合计	10,568.15

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	47,899,107.32
减：卖出股票成本总额	45,867,557.38
买卖股票差价收入	2,031,549.94

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	481,010.97
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	481,010.97
----	------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	3,937,141.67
——股票投资	3,937,141.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	3,937,141.67

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	72,117.85
基金转换费收入	17,228.53
合计	89,346.38

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	172,882.63
银行间市场交易费用	-
合计	172,882.63

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-

银行汇划费	1,459.82
指数使用费	20,000.00
合计	73,528.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	-	-	17,828,789.01	22.75%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	16,604.25	22.75%	-	-

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

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	178,744.77	107,020.54
其中：支付销售机构的客户维护费	60,424.80	38,607.60

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,748.91	21,404.11

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C	合计
广发基金管理有限公司	-	7,045.83	7,045.83
中国工商银行股份有限公司	-	3,734.86	3,734.86
广发证券股份有限公司	-	740.07	740.07
合计	-	11,520.76	11,520.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C	合计
广发基金管理有限公司	-	2,811.82	2,811.82
广发证券股份有限公司	-	2,777.79	2,777.79
中国工商银行股份有限公司	-	2,219.27	2,219.27
合计	-	7,808.88	7,808.88

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	广发中证1000指数 A	广发中证1000指数C	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C
报告期初持有的基金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,800.08	-	10,000,800.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	33.70%	-	43.10%	-

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

广发中证 1000 指数 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发中证 1000 指数 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
中国工商银行股份有限公司	8,054,915.52	9,678.85	2,675,594.25	9,856.32

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600093	*ST 易见	2021-05-06	重大事项停牌	5.93	2021-07-07	5.63	8,200.00	80,857.90	48,626.00	-
688368	晶丰明源	2021-06-21	重大事项停牌	335.26	2021-07-05	402.31	200.00	63,828.00	67,052.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	8,054,915.52	-	-	-	8,054,915.52
存出保证金	15,087.33	-	-	-	15,087.33
交易性金融资产	-	-	-	83,291,653.29	83,291,653.29
应收利息	-	-	-	767.89	767.89
应收申购款	-	-	-	916,635.30	916,635.30
资产总计	8,070,002.85	-	-	84,209,056.48	92,279,059.33

负债：					
应付证券清算款	-	-	-	957,226.47	957,226.47
应付赎回款	-	-	-	1,627,037.02	1,627,037.02
应付管理人报酬	-	-	-	32,265.41	32,265.41
应付托管费	-	-	-	6,453.08	6,453.08
应付销售服务费	-	-	-	11,603.83	11,603.83
应付交易费用	-	-	-	50,090.18	50,090.18
其他负债	-	-	-	62,068.27	62,068.27
负债总计	-	-	-	2,746,744.26	2,746,744.26
利率敏感度缺口	8,070,002.85	-	-	81,462,312.22	89,532,315.07
上年度末					
2020 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
日					
资产：					
银行存款	3,814,715.15	-	-	-	3,814,715.15
结算备付金	20,842.73	-	-	-	20,842.73
存出保证金	8,656.13	-	-	-	8,656.13
交易性金融资产	-	-	-	50,436,212.98	50,436,212.98
应收利息	-	-	-	369.55	369.55
应收申购款	-	-	-	120,390.55	120,390.55
资产总计	3,844,214.01	-	-	50,556,973.08	54,401,187.09
负债：					
应付赎回款	-	-	-	682,971.06	682,971.06
应付管理人报酬	-	-	-	22,732.73	22,732.73
应付托管费	-	-	-	4,546.56	4,546.56
应付销售服务费	-	-	-	6,413.02	6,413.02
应付交易费用	-	-	-	18,995.15	18,995.15
其他负债	-	-	-	107,500.00	107,500.00
负债总计	-	-	-	843,158.52	843,158.52
利率敏感度缺口	3,844,214.01	-	-	49,713,814.56	53,558,028.57

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	83,291,653.29	93.03	50,436,212.98	94.17
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	83,291,653.29	93.03	50,436,212.98	94.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	4,280,214.13	2,546,323.68
	下降 5%	-4,280,214.13	-2,546,323.68

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 83,175,975.29 元，属于第二层次的余额为人民币 115,678.00 元，无属于第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 50,406,554.68 元，属于第二层次的余额为人民币 29,658.30 元，无属于第三层次的金额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	83,291,653.29	90.26
	其中：股票	83,291,653.29	90.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,054,915.52	8.73
8	其他各项资产	932,490.52	1.01
9	合计	92,279,059.33	100.00

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	582,056.25	0.65
B	采矿业	1,671,204.00	1.87
C	制造业	57,599,343.87	64.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,608,360.96	1.80
E	建筑业	1,281,425.00	1.43
F	批发和零售业	2,386,788.20	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,472,275.65	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,743,570.95	9.77
J	金融业	1,351,262.20	1.51
K	房地产业	1,690,597.60	1.89
L	租赁和商务服务业	590,565.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	1,847,651.76	2.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,276,602.00	1.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,605.00	0.04
Q	卫生和社会工作	600,070.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	398,575.85	0.45
S	综合	159,699.00	0.18
	合计	83,291,653.29	93.03

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300012	华测检测	24,000	765,120.00	0.85
2	300496	中科创达	4,100	643,946.00	0.72
3	002568	百润股份	5,400	511,866.00	0.57
4	688005	容百科技	3,766	456,439.20	0.51
5	000516	国际医学	23,000	432,630.00	0.48
6	603345	安井食品	1,600	406,432.00	0.45
7	300363	博腾股份	4,500	378,540.00	0.42
8	603026	石大胜华	2,200	356,510.00	0.40
9	603236	移远通信	2,038	347,703.18	0.39
10	300339	润和软件	8,000	346,880.00	0.39
11	300568	星源材质	8,358	345,770.46	0.39
12	002407	多氟多	9,700	344,738.00	0.39
13	300724	捷佳伟创	2,900	336,429.00	0.38
14	002920	德赛西威	3,000	330,240.00	0.37
15	300458	全志科技	3,700	324,342.00	0.36
16	002402	和而泰	13,100	314,007.00	0.35
17	601058	赛轮轮胎	30,914	308,830.86	0.34
18	300725	药石科技	1,937	307,808.67	0.34
19	002409	雅克科技	3,800	307,800.00	0.34
20	000733	振华科技	5,000	305,350.00	0.34
21	002497	雅化集团	13,200	300,696.00	0.34
22	688116	天奈科技	2,500	295,000.00	0.33
23	603456	九洲药业	6,000	291,480.00	0.33
24	300073	当升科技	5,100	286,569.00	0.32
25	300751	迈为股份	620	281,914.00	0.31
26	603613	国联股份	2,806	280,515.82	0.31
27	600882	妙可蓝多	4,000	279,200.00	0.31
28	600499	科达制造	19,100	275,040.00	0.31
29	603127	昭衍新药	1,480	271,950.00	0.30
30	300327	中颖电子	3,180	271,031.40	0.30
31	603678	火炬电子	3,800	256,500.00	0.29
32	002139	拓邦股份	14,100	253,659.00	0.28
33	002240	盛新锂能	8,700	248,385.00	0.28

34	603267	鸿远电子	1,900	243,048.00	0.27
35	600771	广誉远	6,180	241,638.00	0.27
36	002747	埃斯顿	6,100	238,205.00	0.27
37	000423	东阿阿胶	6,600	237,006.00	0.26
38	600559	老白干酒	9,000	236,700.00	0.26
39	002436	兴森科技	21,400	235,400.00	0.26
40	300390	天华超净	4,900	235,347.00	0.26
41	002245	蔚蓝锂芯	11,900	234,430.00	0.26
42	002145	中核钛白	17,800	230,510.00	0.26
43	603005	晶方科技	3,880	229,812.40	0.26
44	002706	良信股份	10,190	229,682.60	0.26
45	300767	震安科技	2,760	229,218.00	0.26
46	600711	盛屯矿业	30,800	219,604.00	0.25
47	300747	锐科激光	1,925	219,565.50	0.25
48	300373	扬杰科技	3,600	217,944.00	0.24
49	002151	北斗星通	5,000	215,350.00	0.24
50	000818	航锦科技	7,400	214,526.00	0.24
51	601567	三星医疗	9,900	210,870.00	0.24
52	002541	鸿路钢构	3,600	210,060.00	0.23
53	600100	同方股份	34,200	208,962.00	0.23
54	300685	艾德生物	2,000	208,160.00	0.23
55	603185	上机数控	1,150	205,792.50	0.23
56	002389	航天彩虹	9,400	205,202.00	0.23
57	688388	嘉元科技	2,200	200,112.00	0.22
58	300118	东方日升	10,300	199,820.00	0.22
59	002585	双星新材	9,900	199,287.00	0.22
60	600110	诺德股份	16,200	197,316.00	0.22
61	688122	西部超导	3,006	194,999.22	0.22
62	002430	杭氧股份	5,600	193,704.00	0.22
63	300623	捷捷微电	5,100	192,933.00	0.22
64	002626	金达威	4,300	192,210.00	0.21
65	000591	太阳能	30,400	189,392.00	0.21
66	300379	东方通	6,640	189,173.60	0.21
67	601898	中煤能源	26,300	188,045.00	0.21
68	002617	露笑科技	13,800	186,024.00	0.21
69	300502	新易盛	5,900	184,375.00	0.21
70	300679	电连技术	6,295	181,421.90	0.20
71	002025	航天电器	3,600	180,612.00	0.20
72	688139	海尔生物	1,700	178,670.00	0.20
73	300395	菲利华	3,700	178,414.00	0.20
74	603027	千禾味业	6,764	177,825.56	0.20
75	000683	远兴能源	37,900	176,993.00	0.20
76	601678	滨化股份	22,200	175,602.00	0.20
77	600873	梅花生物	31,300	175,280.00	0.20

78	300346	南大光电	4,500	174,060.00	0.19
79	002326	永太科技	8,660	173,113.40	0.19
80	300476	胜宏科技	7,900	172,615.00	0.19
81	002675	东诚药业	8,100	170,667.00	0.19
82	300604	长川科技	2,500	170,525.00	0.19
83	300054	鼎龙股份	9,300	169,725.00	0.19
84	600297	广汇汽车	58,500	168,480.00	0.19
85	002123	梦网科技	9,300	167,958.00	0.19
86	300083	创世纪	15,300	167,535.00	0.19
87	300143	盈康生命	6,500	167,440.00	0.19
88	600963	岳阳林纸	15,600	164,892.00	0.18
89	600305	恒顺醋业	8,588	164,202.56	0.18
90	000831	五矿稀土	8,500	164,050.00	0.18
91	300773	拉卡拉	5,800	163,734.00	0.18
92	002597	金禾实业	4,700	163,090.00	0.18
93	002756	永兴材料	2,700	160,353.00	0.18
94	002163	海南发展	9,200	158,976.00	0.18
95	300672	国科微	1,400	158,942.00	0.18
96	300079	数码视讯	20,600	158,620.00	0.18
97	603128	华贸物流	11,170	157,385.30	0.18
98	300775	三角防务	4,100	156,620.00	0.17
99	002851	麦格米特	4,950	154,588.50	0.17
100	601677	明泰铝业	7,900	154,445.00	0.17
101	002610	爱康科技	64,700	153,986.00	0.17
102	600323	瀚蓝环境	7,050	153,619.50	0.17
103	300763	锦浪科技	850	153,510.00	0.17
104	603588	高能环境	10,600	153,488.00	0.17
105	300348	长亮科技	8,325	152,347.50	0.17
106	002312	川发龙蟒	17,800	152,012.00	0.17
107	300294	博雅生物	4,200	151,830.00	0.17
108	000933	神火股份	16,000	151,200.00	0.17
109	600641	万业企业	8,280	151,027.20	0.17
110	000155	川能动力	10,900	150,529.00	0.17
111	300748	金力永磁	4,720	149,293.60	0.17
112	300777	中简科技	3,300	149,094.00	0.17
113	600966	博汇纸业	11,400	148,770.00	0.17
114	300298	三诺生物	4,700	147,204.00	0.16
115	000034	神州数码	6,700	146,395.00	0.16
116	601375	中原证券	29,900	145,613.00	0.16
117	000902	新洋丰	9,300	145,359.00	0.16
118	600596	新安股份	8,200	145,304.00	0.16
119	600459	贵研铂业	5,875	144,525.00	0.16
120	300036	超图软件	6,600	144,276.00	0.16
121	600583	海油工程	31,900	143,550.00	0.16

122	002614	奥佳华	6,300	142,569.00	0.16
123	600363	联创光电	5,100	142,035.00	0.16
124	002332	仙琚制药	11,300	141,702.00	0.16
125	600456	宝钛股份	3,300	141,570.00	0.16
126	300326	凯利泰	10,400	141,336.00	0.16
127	603308	应流股份	6,840	141,246.00	0.16
128	300567	精测电子	2,300	141,220.00	0.16
129	600151	航天机电	14,400	141,120.00	0.16
130	002291	星期六	7,500	140,850.00	0.16
131	002643	万润股份	7,900	140,462.00	0.16
132	002850	科达利	1,600	139,840.00	0.16
133	002036	联创电子	10,575	139,061.25	0.16
134	000875	吉电股份	24,100	138,334.00	0.15
135	300171	东富龙	3,400	138,210.00	0.15
136	300737	科顺股份	4,375	137,550.00	0.15
137	300451	创业慧康	15,372	135,888.48	0.15
138	002727	一心堂	4,100	135,751.00	0.15
139	688266	泽璟制药-U	1,900	134,349.00	0.15
140	300456	赛微电子	4,430	133,564.50	0.15
141	000035	中国天楹	29,200	133,152.00	0.15
142	002022	科华生物	7,400	132,534.00	0.15
143	601908	京运通	13,800	132,480.00	0.15
144	600252	中恒集团	40,100	131,929.00	0.15
145	600185	格力地产	17,800	131,186.00	0.15
146	000650	仁和药业	12,000	131,040.00	0.15
147	600812	华北制药	12,300	130,995.00	0.15
148	300638	广和通	2,800	130,760.00	0.15
149	300663	科蓝软件	3,400	130,594.00	0.15
150	300068	南都电源	12,300	130,380.00	0.15
151	300369	绿盟科技	8,100	129,195.00	0.14
152	600129	太极集团	6,200	128,774.00	0.14
153	002023	海特高新	8,600	128,312.00	0.14
154	002261	拓维信息	12,600	128,142.00	0.14
155	600267	海正药业	8,500	127,925.00	0.14
156	688006	杭可科技	1,500	127,500.00	0.14
157	300803	指南针	3,300	127,380.00	0.14
158	002810	山东赫达	2,700	127,332.00	0.14
159	002967	广电计量	2,900	127,020.00	0.14
160	300132	青松股份	6,000	126,600.00	0.14
161	000923	河钢资源	6,600	125,862.00	0.14
162	000403	派林生物	4,033	125,506.96	0.14
163	603008	喜临门	3,800	125,438.00	0.14
164	600685	中船防务	6,000	124,800.00	0.14
165	601222	林洋能源	15,000	124,350.00	0.14

166	601519	大智慧	14,300	124,267.00	0.14
167	300236	上海新阳	2,550	123,777.00	0.14
168	002807	江阴银行	31,300	123,322.00	0.14
169	002413	雷科防务	18,400	123,280.00	0.14
170	600577	精达股份	19,300	123,134.00	0.14
171	600206	有研新材	8,600	122,980.00	0.14
172	300226	上海钢联	2,060	122,673.00	0.14
173	002481	双塔食品	10,600	122,536.00	0.14
174	600621	华鑫股份	7,700	122,276.00	0.14
175	002091	江苏国泰	13,400	121,940.00	0.14
176	300188	美亚柏科	7,000	121,800.00	0.14
177	002254	泰和新材	6,000	121,620.00	0.14
178	600993	马应龙	4,200	121,296.00	0.14
179	002239	奥特佳	32,700	120,990.00	0.14
180	601666	平煤股份	17,000	120,870.00	0.14
181	300185	通裕重工	39,400	120,564.00	0.13
182	600197	伊力特	3,900	119,574.00	0.13
183	600688	上海石化	31,800	119,568.00	0.13
184	002063	远光软件	15,084	119,314.44	0.13
185	300487	蓝晓科技	1,400	118,440.00	0.13
186	603039	泛微网络	1,775	118,126.25	0.13
187	600223	鲁商发展	7,300	117,822.00	0.13
188	002318	久立特材	9,800	117,796.00	0.13
189	002126	银轮股份	11,300	117,520.00	0.13
190	002214	大立科技	6,140	117,519.60	0.13
191	603520	司太立	1,900	117,135.00	0.13
192	300352	北信源	16,800	116,928.00	0.13
193	300131	英唐智控	15,300	116,892.00	0.13
194	300323	华灿光电	10,600	116,600.00	0.13
195	600096	云天化	8,200	115,128.00	0.13
196	300616	尚品宅配	1,300	115,063.00	0.13
197	603606	东方电缆	5,700	114,798.00	0.13
198	300393	中来股份	9,280	114,700.80	0.13
199	688158	优刻得-W	2,900	113,825.00	0.13
200	002258	利尔化学	4,400	113,520.00	0.13
201	000059	华锦股份	13,900	113,424.00	0.13
202	300151	昌红科技	4,200	113,148.00	0.13
203	688166	博瑞医药	2,700	112,887.00	0.13
204	300726	宏达电子	1,600	112,784.00	0.13
205	300613	富瀚微	720	112,233.60	0.13
206	601311	骆驼股份	9,700	112,229.00	0.13
207	002099	海翔药业	13,900	112,173.00	0.13
208	002262	恩华药业	7,300	112,055.00	0.13
209	600338	西藏珠峰	7,900	111,943.00	0.13

210	600330	天通股份	11,400	111,834.00	0.12
211	000712	锦龙股份	6,500	111,800.00	0.12
212	300119	瑞普生物	3,300	111,606.00	0.12
213	002531	天顺风能	12,900	111,585.00	0.12
214	002484	江海股份	7,200	111,456.00	0.12
215	300457	赢合科技	5,600	111,216.00	0.12
216	002928	华夏航空	7,350	110,985.00	0.12
217	300123	亚光科技	9,940	110,930.40	0.12
218	600850	电科数字	4,100	110,331.00	0.12
219	603733	仙鹤股份	2,900	110,200.00	0.12
220	603113	金能科技	6,100	110,166.00	0.12
221	000049	德赛电池	2,400	110,160.00	0.12
222	000848	承德露露	9,200	109,848.00	0.12
223	601918	新集能源	22,400	109,536.00	0.12
224	603218	日月股份	4,040	109,403.20	0.12
225	300409	道氏技术	4,600	109,388.00	0.12
226	300674	宇信科技	5,840	109,149.60	0.12
227	600562	国睿科技	7,200	108,504.00	0.12
228	600211	西藏药业	1,720	108,497.60	0.12
229	300233	金城医药	3,800	108,300.00	0.12
230	000976	华铁股份	18,400	108,008.00	0.12
231	000016	深康佳 A	16,200	107,892.00	0.12
232	002285	世联行	17,500	107,275.00	0.12
233	603068	博通集成	1,300	106,990.00	0.12
234	600246	万通发展	11,800	106,436.00	0.12
235	000560	我爱我家	23,800	106,386.00	0.12
236	300034	钢研高纳	3,300	106,293.00	0.12
237	688007	光峰科技	2,518	105,453.84	0.12
238	300666	江丰电子	2,100	104,727.00	0.12
239	002400	省广集团	20,100	104,319.00	0.12
240	000735	罗牛山	13,200	104,148.00	0.12
241	688202	美迪西	200	103,980.00	0.12
242	000627	天茂集团	28,500	103,170.00	0.12
243	000672	上峰水泥	5,900	103,132.00	0.12
244	603583	捷昌驱动	2,036	103,062.32	0.12
245	000555	神州信息	7,100	102,737.00	0.11
246	600059	古越龙山	7,900	102,384.00	0.11
247	600773	西藏城投	7,200	102,096.00	0.11
248	600587	新华医疗	4,500	101,925.00	0.11
249	603429	集友股份	3,120	101,400.00	0.11
250	688023	安恒信息	400	100,800.00	0.11
251	300101	振芯科技	5,600	100,296.00	0.11
252	300598	诚迈科技	1,200	100,284.00	0.11
253	601965	中国汽研	5,800	100,224.00	0.11

254	000917	电广传媒	20,400	100,164.00	0.11
255	002833	弘亚数控	2,584	100,130.00	0.11
256	600635	大众公用	27,900	99,603.00	0.11
257	002171	楚江新材	11,400	99,522.00	0.11
258	600063	皖维高新	19,400	99,328.00	0.11
259	603129	春风动力	800	99,264.00	0.11
260	601028	玉龙股份	5,600	99,120.00	0.11
261	603187	海容冷链	2,300	98,624.00	0.11
262	002079	苏州固锴	7,800	98,280.00	0.11
263	600320	振华重工	28,800	97,632.00	0.11
264	600682	南京新百	9,700	97,582.00	0.11
265	600360	华微电子	10,730	97,213.80	0.11
266	000582	北部湾港	11,700	97,110.00	0.11
267	603596	伯特利	2,700	96,525.00	0.11
268	603599	广信股份	3,200	96,256.00	0.11
269	600057	厦门象屿	15,400	96,250.00	0.11
270	603025	大豪科技	2,500	96,050.00	0.11
271	300377	赢时胜	8,600	95,804.00	0.11
272	002100	天康生物	10,700	95,337.00	0.11
273	002832	比音勒芬	3,720	95,194.80	0.11
274	300639	凯普生物	2,878	95,002.78	0.11
275	000921	海信家电	6,600	94,842.00	0.11
276	600496	精工钢构	23,200	94,656.00	0.11
277	603489	八方股份	400	94,552.00	0.11
278	300149	睿智医药	4,900	94,521.00	0.11
279	002097	山河智能	11,000	94,380.00	0.11
280	002237	恒邦股份	8,200	94,218.00	0.11
281	002698	博实股份	7,400	94,202.00	0.11
282	300087	荃银高科	4,200	94,122.00	0.11
283	300841	康华生物	350	94,080.00	0.11
284	300102	乾照光电	10,100	93,829.00	0.10
285	600740	山西焦化	18,462	93,786.96	0.10
286	600797	浙大网新	14,000	93,520.00	0.10
287	002428	云南锗业	7,500	92,925.00	0.10
288	600720	祁连山	8,800	92,752.00	0.10
288	002310	东方园林	27,200	92,752.00	0.10
289	300776	帝尔激光	620	92,603.20	0.10
290	002106	莱宝高科	8,200	92,250.00	0.10
291	600055	万东医疗	5,500	92,125.00	0.10
292	002130	沃尔核材	14,400	92,016.00	0.10
293	000951	中国重汽	3,400	92,004.00	0.10
294	603686	龙马环卫	6,020	91,564.20	0.10
295	688016	心脉医疗	200	90,922.00	0.10
296	300055	万邦达	9,900	90,882.00	0.10

297	300438	鹏辉能源	3,950	90,455.00	0.10
298	605111	新洁能	500	90,135.00	0.10
299	600612	老凤祥	1,700	90,049.00	0.10
300	603298	杭叉集团	4,960	89,974.40	0.10
301	600984	建设机械	8,400	89,964.00	0.10
302	600864	哈投股份	14,900	89,698.00	0.10
303	300222	科大智能	7,300	89,498.00	0.10
304	300319	麦捷科技	7,400	89,170.00	0.10
305	000969	安泰科技	10,300	88,580.00	0.10
306	002335	科华数据	3,880	88,347.60	0.10
307	300085	银之杰	5,000	88,250.00	0.10
308	603979	金诚信	4,900	88,200.00	0.10
309	002803	吉宏股份	3,100	87,978.00	0.10
310	002556	辉隆股份	8,100	87,885.00	0.10
311	000767	晋控电力	26,500	87,450.00	0.10
312	002351	漫步者	6,450	87,333.00	0.10
313	688188	柏楚电子	200	87,200.00	0.10
314	601001	晋控煤业	12,000	87,120.00	0.10
315	000710	贝瑞基因	2,900	87,116.00	0.10
316	002859	洁美科技	2,780	86,930.60	0.10
317	603018	华设集团	10,912	86,750.40	0.10
318	603713	密尔克卫	800	86,384.00	0.10
319	002467	二六三	19,680	86,198.40	0.10
320	600578	京能电力	28,900	86,122.00	0.10
321	600490	鹏欣资源	22,300	85,855.00	0.10
322	002324	普利特	7,320	85,644.00	0.10
323	000928	中钢国际	9,000	85,590.00	0.10
324	300287	飞利信	15,500	85,405.00	0.10
325	300184	力源信息	13,400	85,224.00	0.10
326	000851	高鸿股份	12,800	85,120.00	0.10
327	300662	科锐国际	1,400	84,868.00	0.09
328	002421	达实智能	22,100	84,864.00	0.09
329	603690	至纯科技	2,100	84,861.00	0.09
330	300573	兴齐眼药	600	84,618.00	0.09
331	300219	鸿利智汇	6,400	84,480.00	0.09
332	600503	华丽家族	23,100	84,315.00	0.09
333	688366	昊海生科	400	83,720.00	0.09
334	600378	昊华科技	3,800	83,714.00	0.09
335	002581	未名医药	4,600	83,628.00	0.09
336	601212	白银有色	32,000	83,520.00	0.09
337	603919	金徽酒	2,030	83,473.60	0.09
338	603718	海利生物	5,600	83,440.00	0.09
339	603881	数据港	2,300	83,260.00	0.09
340	300232	洲明科技	9,320	83,227.60	0.09

341	601952	苏垦农发	8,000	83,040.00	0.09
342	600761	安徽合力	7,500	82,950.00	0.09
343	600210	紫江企业	17,400	82,650.00	0.09
344	002274	华昌化工	8,200	82,574.00	0.09
345	002020	京新药业	9,640	81,940.00	0.09
346	600483	福能股份	7,800	81,822.00	0.09
347	002649	博彦科技	7,700	80,850.00	0.09
348	603043	广州酒家	3,140	80,760.80	0.09
349	002216	三全食品	4,900	80,703.00	0.09
350	002158	汉钟精机	3,000	80,550.00	0.09
351	603368	柳药股份	4,080	80,539.20	0.09
352	002293	罗莱生活	6,000	80,340.00	0.09
353	600986	浙文互联	19,100	80,220.00	0.09
354	300497	富祥药业	6,368	80,173.12	0.09
355	000789	万年青	6,990	79,965.60	0.09
356	300770	新媒股份	1,640	79,868.00	0.09
357	600742	一汽富维	7,800	79,482.00	0.09
358	600662	强生控股	9,100	79,443.00	0.09
359	300158	振东制药	10,300	79,413.00	0.09
360	300397	天和防务	4,080	79,356.00	0.09
361	603323	苏农银行	18,090	79,234.20	0.09
362	002182	云海金属	6,600	79,068.00	0.09
363	300406	九强生物	4,000	78,920.00	0.09
364	002108	沧州明珠	14,300	78,793.00	0.09
365	002611	东方精工	17,000	78,710.00	0.09
366	001696	宗申动力	9,800	78,204.00	0.09
367	601369	陕鼓动力	9,600	78,048.00	0.09
368	300398	飞凯材料	4,300	77,959.00	0.09
369	002043	兔宝宝	7,900	77,894.00	0.09
370	603612	索通发展	4,300	77,271.00	0.09
371	600073	上海梅林	9,400	76,986.00	0.09
372	300355	蒙草生态	18,500	76,405.00	0.09
373	002206	海利得	12,300	76,383.00	0.09
374	000503	国新健康	10,300	76,323.00	0.09
375	000793	华闻集团	28,800	76,320.00	0.09
376	002222	福晶科技	4,700	76,187.00	0.09
377	600123	兰花科创	9,800	75,852.00	0.08
378	300783	三只松鼠	1,600	75,776.00	0.08
379	000603	盛达资源	6,000	75,540.00	0.08
380	300170	汉得信息	10,100	75,447.00	0.08
381	300053	欧比特	8,100	75,249.00	0.08
382	600295	鄂尔多斯	4,200	75,138.00	0.08
383	002539	云图控股	8,600	75,078.00	0.08
384	603915	国茂股份	1,900	75,050.00	0.08

385	000657	中钨高新	7,400	75,036.00	0.08
386	300624	万兴科技	1,280	74,982.40	0.08
387	300607	拓斯达	2,153	74,924.40	0.08
388	600422	昆药集团	7,700	74,690.00	0.08
389	300303	聚飞光电	14,600	74,314.00	0.08
390	002041	登海种业	4,900	74,039.00	0.08
391	300177	中海达	7,500	73,950.00	0.08
392	605376	博迁新材	1,000	73,880.00	0.08
393	600072	中船科技	6,400	73,600.00	0.08
393	600789	鲁抗医药	10,000	73,600.00	0.08
394	300470	中密控股	1,900	73,416.00	0.08
395	300078	思创医惠	9,900	73,260.00	0.08
396	002201	九鼎新材	4,700	73,085.00	0.08
397	300401	花园生物	5,600	73,080.00	0.08
398	000612	焦作万方	10,300	73,027.00	0.08
399	600420	国药现代	7,400	72,890.00	0.08
400	600750	江中药业	5,500	72,875.00	0.08
401	002726	龙大肉食	7,200	72,864.00	0.08
402	002449	国星光电	7,200	72,720.00	0.08
403	000903	云内动力	18,500	72,520.00	0.08
404	000829	天音控股	8,800	72,512.00	0.08
405	300682	朗新科技	4,300	72,326.00	0.08
406	603826	坤彩科技	1,900	72,067.00	0.08
407	600751	海航科技	25,900	72,002.00	0.08
408	603601	再升科技	6,200	71,734.00	0.08
409	002035	华帝股份	9,900	71,478.00	0.08
410	000828	东莞控股	6,000	71,460.00	0.08
411	300792	壹网壹创	1,400	71,442.00	0.08
412	603876	鼎胜新材	2,300	71,415.00	0.08
413	000088	盐田港	12,864	71,266.56	0.08
414	688033	天宜上佳	4,460	70,869.40	0.08
415	600169	太原重工	28,800	70,848.00	0.08
416	600326	西藏天路	10,500	70,770.00	0.08
417	688389	普门科技	2,300	70,518.00	0.08
418	600997	开滦股份	9,400	70,500.00	0.08
419	600017	日照港	26,400	70,488.00	0.08
420	600491	龙元建设	13,100	70,478.00	0.08
421	688018	乐鑫科技	300	70,026.00	0.08
422	002461	珠江啤酒	6,400	70,016.00	0.08
423	600512	腾达建设	23,000	69,920.00	0.08
424	600770	综艺股份	11,200	69,776.00	0.08
425	002488	金固股份	11,400	69,654.00	0.08
426	000901	航天科技	8,070	69,644.10	0.08
427	600604	市北高新	12,000	69,600.00	0.08

428	603960	克来机电	2,100	69,510.00	0.08
429	300633	开立医疗	2,200	69,476.00	0.08
430	600337	美克家居	16,500	69,465.00	0.08
431	300755	华致酒行	1,700	69,377.00	0.08
432	002276	万马股份	10,400	69,368.00	0.08
433	300031	宝通科技	4,400	69,344.00	0.08
434	000036	华联控股	14,880	69,340.80	0.08
435	300596	利安隆	1,600	69,328.00	0.08
436	600285	羚锐制药	6,600	69,300.00	0.08
437	600391	航发科技	3,200	69,152.00	0.08
438	601827	三峰环境	7,300	69,131.00	0.08
439	002918	蒙娜丽莎	2,200	69,058.00	0.08
440	300429	强力新材	5,080	68,834.00	0.08
441	603387	基蛋生物	3,060	68,788.80	0.08
442	600389	江山股份	2,000	68,780.00	0.08
443	002567	唐人神	10,400	68,744.00	0.08
444	002498	汉缆股份	19,200	68,736.00	0.08
445	002425	凯撒文化	8,200	68,634.00	0.08
446	600116	三峡水利	8,200	68,552.00	0.08
447	000592	平潭发展	22,300	68,461.00	0.08
448	603989	艾华集团	2,100	68,439.00	0.08
449	000811	冰轮环境	6,500	68,250.00	0.08
450	000006	深振业 A	13,600	68,136.00	0.08
451	600581	八一钢铁	11,000	67,980.00	0.08
452	000550	江铃汽车	2,900	67,947.00	0.08
453	000913	钱江摩托	3,800	67,906.00	0.08
454	603801	志邦家居	2,120	67,755.20	0.08
455	000070	特发信息	8,340	67,720.80	0.08
456	300735	光弘科技	5,566	67,682.56	0.08
457	000958	东方能源	15,400	67,606.00	0.08
458	002446	盛路通信	10,400	67,600.00	0.08
459	300525	博思软件	3,800	67,450.00	0.08
460	600557	康缘药业	6,000	67,440.00	0.08
461	002646	青青稞酒	3,100	67,394.00	0.08
462	300145	中金环境	22,100	67,184.00	0.08
463	600502	安徽建工	17,300	67,124.00	0.07
464	600531	豫光金铅	12,700	67,056.00	0.07
465	688368	晶丰明源	200	67,052.00	0.07
466	000915	华特达因	2,500	66,825.00	0.07
467	600395	盘江股份	9,400	66,740.00	0.07
468	300696	爱乐达	1,600	66,592.00	0.07
469	601011	宝泰隆	16,200	66,582.00	0.07
470	601137	博威合金	5,800	66,526.00	0.07
471	000676	智度股份	10,940	66,405.80	0.07

472	600277	亿利洁能	19,700	66,389.00	0.07
473	600366	宁波韵升	9,900	66,330.00	0.07
474	600477	杭萧钢构	18,540	66,187.80	0.07
475	300738	奥飞数据	3,180	66,112.20	0.07
476	300208	青岛中程	6,500	66,040.00	0.07
477	300394	天孚通信	2,600	65,832.00	0.07
478	002677	浙江美大	3,600	65,808.00	0.07
479	603179	新泉股份	2,000	65,760.00	0.07
480	002891	中宠股份	1,600	65,600.00	0.07
481	600103	青山纸业	26,370	65,397.60	0.07
482	601163	三角轮胎	4,500	65,340.00	0.07
483	688298	东方生物	300	65,280.00	0.07
483	002737	葵花药业	4,000	65,280.00	0.07
484	300224	正海磁材	6,000	65,220.00	0.07
485	300821	东岳硅材	5,000	65,000.00	0.07
486	000566	海南海药	11,100	64,935.00	0.07
487	002636	金安国纪	4,000	64,880.00	0.07
488	300075	数字政通	5,500	64,735.00	0.07
489	300307	慈星股份	7,900	64,622.00	0.07
490	600308	华泰股份	11,700	64,584.00	0.07
491	600125	铁龙物流	13,100	64,583.00	0.07
492	300702	天宇股份	1,820	64,464.40	0.07
493	002301	齐心集团	6,400	64,256.00	0.07
494	300006	莱美药业	9,100	64,155.00	0.07
495	600284	浦东建设	9,700	64,117.00	0.07
496	603877	太平鸟	1,200	64,056.00	0.07
497	300020	银江股份	7,500	64,050.00	0.07
498	300477	合纵科技	9,260	63,801.40	0.07
499	002960	青鸟消防	2,438	63,778.08	0.07
500	000030	富奥股份	10,000	63,700.00	0.07
501	300206	理邦仪器	4,000	63,600.00	0.07
502	002226	江南化工	12,420	63,590.40	0.07
503	601126	四方股份	7,100	63,545.00	0.07
504	600108	亚盛集团	22,400	63,392.00	0.07
505	000652	泰达股份	14,700	63,357.00	0.07
506	002042	华孚时尚	13,100	63,273.00	0.07
507	300263	隆华科技	9,200	63,204.00	0.07
508	300194	福安药业	13,700	62,883.00	0.07
509	002292	奥飞娱乐	9,700	62,856.00	0.07
510	002647	仁东控股	5,700	62,814.00	0.07
511	002544	杰赛科技	4,700	62,698.00	0.07
512	002283	天润工业	11,300	62,602.00	0.07
513	000543	皖能电力	16,500	62,535.00	0.07
514	002190	成飞集成	2,400	62,376.00	0.07

515	300114	中航电测	4,100	62,320.00	0.07
516	300378	鼎捷软件	2,900	62,263.00	0.07
517	600452	涪陵电力	4,320	62,078.40	0.07
518	603279	景津环保	2,800	62,048.00	0.07
519	603118	共进股份	6,700	61,841.00	0.07
520	300768	迪普科技	1,600	61,808.00	0.07
521	002367	康力电梯	6,900	61,686.00	0.07
522	300134	大富科技	5,500	61,655.00	0.07
523	603301	振德医疗	1,400	61,488.00	0.07
524	600846	同济科技	7,200	61,344.00	0.07
525	002376	新北洋	6,700	61,238.00	0.07
526	600480	凌云股份	6,680	61,188.80	0.07
527	603916	苏博特	2,960	61,094.40	0.07
528	600810	神马股份	5,100	61,047.00	0.07
529	601619	嘉泽新能	16,000	60,960.00	0.07
530	300045	华力创通	6,200	60,884.00	0.07
531	000989	九芝堂	6,200	60,760.00	0.07
532	600748	上实发展	13,200	60,720.00	0.07
533	603305	旭升股份	1,800	60,714.00	0.07
534	300266	兴源环境	15,800	60,672.00	0.07
535	000823	超声电子	5,400	60,642.00	0.07
536	600756	浪潮软件	4,500	60,570.00	0.07
537	603378	亚士创能	1,100	60,522.00	0.07
538	300602	飞荣达	3,400	60,520.00	0.07
539	300762	上海瀚讯	2,140	60,455.00	0.07
540	300292	吴通控股	15,300	60,435.00	0.07
541	300659	中孚信息	1,800	60,426.00	0.07
542	600552	凯盛科技	8,700	60,204.00	0.07
542	300441	鲍斯股份	5,800	60,204.00	0.07
543	002697	红旗连锁	11,700	60,138.00	0.07
544	603313	梦百合	2,000	60,100.00	0.07
545	002906	华阳集团	1,900	60,002.00	0.07
546	000667	美好置业	35,500	59,995.00	0.07
547	002847	盐津铺子	600	59,832.00	0.07
548	002055	得润电子	4,600	59,708.00	0.07
549	688037	芯源微	400	59,600.00	0.07
550	603566	普莱柯	2,600	59,280.00	0.07
551	002605	姚记科技	2,700	59,049.00	0.07
552	603060	国检集团	3,456	58,959.36	0.07
553	000801	四川九洲	8,700	58,899.00	0.07
554	300238	冠昊生物	2,900	58,841.00	0.07
555	300007	汉威科技	3,200	58,752.00	0.07
556	300740	水羊股份	2,800	58,464.00	0.07
557	300572	安车检测	1,800	58,392.00	0.07

558	600694	大商股份	2,800	58,128.00	0.06
559	601929	吉视传媒	31,400	58,090.00	0.06
560	002537	海联金汇	10,600	57,876.00	0.06
561	600971	恒源煤电	8,700	57,855.00	0.06
562	601886	江河集团	6,700	57,754.00	0.06
563	603393	新天然气	3,152	57,618.56	0.06
564	600710	苏美达	9,300	57,474.00	0.06
565	002135	东南网架	7,500	57,375.00	0.06
566	300353	东土科技	5,900	57,348.00	0.06
567	000697	炼石航空	6,800	57,324.00	0.06
568	601890	亚星锚链	9,600	57,312.00	0.06
569	002437	誉衡药业	22,100	57,239.00	0.06
570	603416	信捷电气	900	57,123.00	0.06
571	000032	深桑达 A	3,000	57,090.00	0.06
572	002695	煌上煌	3,600	56,988.00	0.06
573	300284	苏交科	9,740	56,979.00	0.06
574	300256	星星科技	11,000	56,870.00	0.06
575	002320	海峡股份	9,687	56,862.69	0.06
576	000881	中广核技	5,500	56,760.00	0.06
577	603688	石英股份	2,400	56,400.00	0.06
578	300322	硕贝德	4,500	56,385.00	0.06
579	000507	珠海港	9,300	56,265.00	0.06
580	300267	尔康制药	14,700	56,154.00	0.06
581	600565	迪马股份	22,100	56,134.00	0.06
582	600668	尖峰集团	4,700	56,118.00	0.06
583	688333	铂力特	300	56,073.00	0.06
584	300657	弘信电子	3,300	55,935.00	0.06
585	600075	新疆天业	8,200	55,760.00	0.06
586	002479	富春环保	8,600	55,642.00	0.06
587	300229	拓尔思	6,200	55,614.00	0.06
588	000682	东方电子	11,500	55,315.00	0.06
589	002251	步步高	7,500	55,200.00	0.06
590	002596	海南瑞泽	11,400	55,062.00	0.06
591	603108	润达医疗	4,900	55,027.00	0.06
592	300653	正海生物	700	54,810.00	0.06
593	000910	大亚圣象	4,600	54,648.00	0.06
594	002639	雪人股份	7,800	54,600.00	0.06
595	002913	奥士康	700	54,565.00	0.06
596	600602	云赛智联	9,200	54,556.00	0.06
597	300366	创意信息	6,100	54,412.00	0.06
598	600343	航天动力	5,500	54,395.00	0.06
599	002309	中利集团	8,700	54,288.00	0.06
600	002218	拓日新能	9,000	54,270.00	0.06
601	002530	金财互联	5,600	54,208.00	0.06

602	600133	东湖高新	9,100	54,145.00	0.06
603	300248	新开普	5,500	54,120.00	0.06
604	300047	天源迪科	7,400	54,020.00	0.06
605	000936	华西股份	7,700	53,900.00	0.06
606	601588	北辰实业	23,000	53,820.00	0.06
607	300709	精研科技	1,260	53,764.20	0.06
608	300368	汇金股份	4,400	53,724.00	0.06
609	000900	现代投资	13,100	53,579.00	0.06
610	002298	中电兴发	7,500	53,550.00	0.06
611	688066	航天宏图	1,300	53,547.00	0.06
612	002777	久远银海	3,020	53,423.80	0.06
613	603766	隆鑫通用	14,700	53,361.00	0.06
614	300091	金通灵	12,700	53,340.00	0.06
615	002015	协鑫能科	5,900	53,277.00	0.06
616	002912	中新赛克	1,300	53,261.00	0.06
617	603609	禾丰股份	5,100	53,142.00	0.06
618	300579	数字认证	1,118	53,071.46	0.06
619	300761	立华股份	1,600	53,008.00	0.06
620	002733	雄韬股份	3,200	52,992.00	0.06
621	300203	聚光科技	4,400	52,976.00	0.06
622	600590	泰豪科技	7,400	52,910.00	0.06
623	600105	永鼎股份	13,800	52,716.00	0.06
624	601606	长城军工	5,100	52,683.00	0.06
625	300850	新强联	600	52,614.00	0.06
626	300183	东软载波	3,200	52,544.00	0.06
627	002550	千红制药	12,800	52,480.00	0.06
628	600114	东睦股份	6,240	52,353.60	0.06
629	300910	瑞丰新材	500	52,275.00	0.06
630	000931	中关村	7,600	52,212.00	0.06
631	300109	新开源	3,100	52,142.00	0.06
632	002651	利君股份	4,300	51,987.00	0.06
633	002061	浙江交科	9,800	51,940.00	0.06
634	000810	创维数字	6,100	51,911.00	0.06
635	002573	清新环境	10,000	51,600.00	0.06
636	600624	复旦复华	6,900	51,543.00	0.06
637	300190	维尔利	7,900	51,429.00	0.06
638	603533	掌阅科技	1,800	51,300.00	0.06
639	002383	合众思壮	6,500	51,285.00	0.06
640	002489	浙江永强	14,600	51,246.00	0.06
641	002668	奥马电器	9,300	51,243.00	0.06
642	300527	中船应急	5,566	51,151.54	0.06
643	600569	安阳钢铁	16,700	51,102.00	0.06
644	002930	宏川智慧	3,110	50,910.70	0.06
645	000601	韶能股份	9,300	50,778.00	0.06

646	688399	硕世生物	300	50,580.00	0.06
647	000600	建投能源	10,300	50,573.00	0.06
648	300455	康拓红外	5,000	50,350.00	0.06
649	000950	重药控股	10,000	50,300.00	0.06
650	600217	中再资环	9,900	50,292.00	0.06
651	300510	金冠股份	8,379	50,274.00	0.06
652	300439	美康生物	2,600	50,180.00	0.06
653	601949	中国出版	7,900	50,165.00	0.06
654	603997	继峰股份	6,100	50,142.00	0.06
655	300386	飞天诚信	2,900	49,967.00	0.06
656	002798	帝欧家居	3,200	49,856.00	0.06
657	002435	长江健康	8,800	49,720.00	0.06
658	002641	永高股份	7,200	49,680.00	0.06
659	002194	武汉凡谷	3,700	49,543.00	0.06
660	002741	光华科技	3,100	49,507.00	0.06
661	300766	每日互动	3,300	49,467.00	0.06
662	002522	浙江众成	7,900	49,454.00	0.06
663	300349	金卡智能	4,200	49,266.00	0.06
664	300448	浩云科技	6,000	49,200.00	0.05
665	300065	海兰信	4,400	49,148.00	0.05
666	603111	康尼机电	9,900	49,005.00	0.05
667	600261	阳光照明	12,500	48,875.00	0.05
668	603587	地素时尚	1,960	48,823.60	0.05
669	002378	章源钨业	5,200	48,776.00	0.05
670	600783	鲁信创投	4,100	48,667.00	0.05
671	600093	*ST 易见	8,200	48,626.00	0.05
672	600575	淮河能源	22,400	48,608.00	0.05
673	002243	力合科创	5,100	48,501.00	0.05
674	000795	英洛华	9,700	48,403.00	0.05
675	600458	时代新材	5,800	48,314.00	0.05
676	600831	广电网络	8,200	48,298.00	0.05
677	300191	潜能恒信	2,100	48,258.00	0.05
678	603363	傲农生物	4,680	48,204.00	0.05
679	000882	华联股份	27,700	48,198.00	0.05
680	600715	文投控股	15,900	48,177.00	0.05
681	603636	南威软件	5,000	48,150.00	0.05
682	000597	东北制药	9,605	48,121.05	0.05
683	603337	杰克股份	1,800	48,114.00	0.05
684	300664	鹏鹞环保	7,200	48,096.00	0.05
685	002277	友阿股份	13,900	48,094.00	0.05
686	000926	福星股份	11,000	48,070.00	0.05
687	000973	佛塑科技	11,100	47,952.00	0.05
688	600990	四创电子	1,200	47,724.00	0.05
689	002582	好想你	5,100	47,685.00	0.05

690	603666	亿嘉和	520	47,403.20	0.05
691	002104	恒宝股份	8,000	47,360.00	0.05
692	688200	华峰测控	100	47,333.00	0.05
693	300523	辰安科技	1,950	47,307.00	0.05
694	002516	旷达科技	8,900	47,170.00	0.05
695	300080	易成新能	9,000	47,160.00	0.05
696	002161	远望谷	8,600	47,128.00	0.05
697	603208	江山欧派	500	46,995.00	0.05
698	600933	爱柯迪	3,600	46,944.00	0.05
699	000796	凯撒旅业	5,000	46,750.00	0.05
700	002515	金字火腿	9,800	46,746.00	0.05
701	000546	金圆股份	7,200	46,728.00	0.05
702	300039	上海凯宝	9,000	46,710.00	0.05
703	002115	三维通信	8,170	46,650.70	0.05
704	600736	苏州高新	9,900	46,530.00	0.05
705	300388	节能国祯	6,100	46,360.00	0.05
706	601366	利群股份	7,400	46,324.00	0.05
707	002034	旺能环境	2,900	46,255.00	0.05
708	300310	宜通世纪	10,000	46,200.00	0.05
709	300299	富春股份	8,000	46,160.00	0.05
710	002117	东港股份	5,500	46,145.00	0.05
711	300311	任子行	7,800	46,098.00	0.05
712	300215	电科院	5,500	46,090.00	0.05
713	002518	科士达	3,200	45,984.00	0.05
714	002717	岭南股份	15,250	45,902.50	0.05
715	300066	三川智慧	9,000	45,810.00	0.05
716	000639	西王食品	7,800	45,786.00	0.05
717	300130	新国都	4,000	45,760.00	0.05
718	002768	国恩股份	1,800	45,684.00	0.05
719	688198	佰仁医疗	200	45,600.00	0.05
720	603348	文灿股份	1,300	45,500.00	0.05
721	002166	莱茵生物	5,800	45,240.00	0.05
722	603012	创力集团	7,400	45,214.00	0.05
723	300328	宜安科技	5,950	45,101.00	0.05
724	002609	捷顺科技	4,500	45,045.00	0.05
725	601069	西部黄金	3,600	45,036.00	0.05
726	603896	寿仙谷	1,100	44,814.00	0.05
727	300198	纳川股份	11,800	44,722.00	0.05
728	002267	陕天然气	6,500	44,655.00	0.05
729	300110	华仁药业	10,100	44,541.00	0.05
730	600636	国新文化	4,400	44,528.00	0.05
731	002215	诺普信	7,900	44,398.00	0.05
732	300016	北陆药业	4,900	44,394.00	0.05
733	002822	中装建设	7,300	44,384.00	0.05

734	300205	天喻信息	3,600	44,316.00	0.05
735	600449	宁夏建材	3,900	44,304.00	0.05
736	000557	西部创业	12,500	44,250.00	0.05
737	300255	常山药业	6,700	44,220.00	0.05
737	600975	新五丰	6,600	44,220.00	0.05
738	002672	东江环保	5,900	44,191.00	0.05
739	002197	证通电子	6,000	44,040.00	0.05
740	002975	博杰股份	500	44,000.00	0.05
741	002950	奥美医疗	2,650	43,884.00	0.05
742	600495	晋西车轴	12,100	43,681.00	0.05
743	600550	保变电气	10,500	43,680.00	0.05
744	000935	四川双马	3,200	43,648.00	0.05
745	300552	万集科技	1,300	43,264.00	0.05
746	300829	金丹科技	660	43,230.00	0.05
747	603328	依顿电子	5,800	43,210.00	0.05
748	300302	同有科技	4,000	43,160.00	0.05
749	002547	春兴精工	9,700	43,068.00	0.05
750	002512	达华智能	11,400	42,864.00	0.05
751	002322	理工环科	3,800	42,750.00	0.05
752	300204	舒泰神	3,300	42,702.00	0.05
753	603936	博敏电子	3,600	42,660.00	0.05
754	002017	东信和平	3,700	42,291.00	0.05
755	600775	南京熊猫	5,900	42,244.00	0.05
756	300861	美畅股份	500	42,155.00	0.05
757	002664	长鹰信质	2,700	42,147.00	0.05
758	002657	中科金财	3,700	42,032.00	0.05
759	000040	东旭蓝天	14,900	41,869.00	0.05
760	600331	宏达股份	20,500	41,820.00	0.05
761	300684	中石科技	1,900	41,705.00	0.05
762	600894	广日股份	6,200	41,664.00	0.05
763	002565	顺灏股份	10,600	41,658.00	0.05
764	002685	华东重机	8,600	41,624.00	0.05
765	600855	航天长峰	3,100	41,292.00	0.05
766	603959	百利科技	4,000	41,160.00	0.05
767	000688	国城矿业	4,700	41,031.00	0.05
768	300520	科大国创	1,900	40,945.00	0.05
769	300276	三丰智能	10,300	40,891.00	0.05
770	002519	银河电子	9,700	40,837.00	0.05
771	002204	大连重工	11,100	40,737.00	0.05
772	600510	黑牡丹	6,100	40,687.00	0.05
773	002545	东方铁塔	5,400	40,608.00	0.05
774	603728	鸣志电器	2,300	40,457.00	0.05
775	002047	宝鹰股份	11,500	40,365.00	0.05
776	603920	世运电路	2,870	40,266.10	0.04

777	300081	恒信东方	5,200	40,092.00	0.04
778	603229	奥翔药业	1,200	40,068.00	0.04
779	002228	合兴包装	10,600	39,750.00	0.04
780	002542	中化岩土	13,000	39,260.00	0.04
781	600318	新力金融	5,000	39,200.00	0.04
782	002993	奥海科技	900	39,195.00	0.04
783	300252	金信诺	4,900	39,151.00	0.04
784	300548	博创科技	1,100	39,149.00	0.04
785	600184	光电股份	3,600	39,132.00	0.04
786	002970	锐明技术	900	39,069.00	0.04
787	002838	道恩股份	2,200	39,028.00	0.04
788	002314	南山控股	11,700	38,961.00	0.04
789	000918	嘉凯城	8,900	38,893.00	0.04
790	600622	光大嘉宝	12,820	38,844.60	0.04
791	002364	中恒电气	4,700	38,822.00	0.04
792	002308	威创股份	9,100	38,675.00	0.04
793	600523	贵航股份	2,700	38,664.00	0.04
794	002303	美盈森	11,000	38,610.00	0.04
795	600981	汇鸿集团	12,800	38,528.00	0.04
796	603466	风语筑	2,355	38,504.25	0.04
797	600874	创业环保	6,300	38,493.00	0.04
798	300723	一品红	1,140	38,475.00	0.04
799	600603	广汇物流	9,500	38,380.00	0.04
800	002961	瑞达期货	1,800	38,376.00	0.04
801	300815	玉禾田	1,100	38,313.00	0.04
802	002837	英维克	2,100	37,989.00	0.04
803	300673	佩蒂股份	1,700	37,842.00	0.04
804	300423	昇辉科技	3,400	37,570.00	0.04
805	000498	山东路桥	6,700	37,520.00	0.04
806	002344	海宁皮城	9,200	37,444.00	0.04
807	603887	城地香江	3,740	37,362.60	0.04
808	600335	国机汽车	6,300	37,359.00	0.04
809	002662	京威股份	10,700	37,236.00	0.04
810	600592	龙溪股份	3,900	37,206.00	0.04
811	002761	浙江建投	4,500	37,125.00	0.04
812	000065	北方国际	4,300	37,109.00	0.04
813	603579	荣泰健康	900	36,972.00	0.04
814	603590	康辰药业	1,000	36,890.00	0.04
815	601330	绿色动力	4,100	36,449.00	0.04
816	603626	科森科技	4,000	36,400.00	0.04
817	300318	博晖创新	4,500	36,315.00	0.04
818	601515	东风股份	5,800	36,308.00	0.04
819	002313	日海智能	3,100	36,301.00	0.04
820	605009	豪悦护理	500	36,185.00	0.04

821	600676	交运股份	8,800	36,168.00	0.04
822	688278	特宝生物	1,000	36,100.00	0.04
823	002234	民和股份	2,400	36,072.00	0.04
824	000968	蓝焰控股	5,600	35,952.00	0.04
825	300531	优博讯	2,300	35,880.00	0.04
826	603180	金牌厨柜	752	35,862.88	0.04
827	002979	雷赛智能	1,250	35,837.50	0.04
828	600054	黄山旅游	3,600	35,424.00	0.04
829	688086	紫晶存储	1,400	35,364.00	0.04
830	300571	平治信息	1,000	35,300.00	0.04
831	000011	深物业 A	2,900	35,264.00	0.04
832	300043	星辉娱乐	10,700	35,203.00	0.04
833	603730	岱美股份	1,925	35,073.50	0.04
834	603359	东珠生态	2,100	35,028.00	0.04
835	000797	中国武夷	11,200	34,944.00	0.04
836	000885	城发环境	3,640	34,798.40	0.04
837	601609	金田铜业	4,000	34,720.00	0.04
838	688100	威胜信息	1,300	34,710.00	0.04
839	300365	恒华科技	4,200	34,440.00	0.04
839	601700	风范股份	8,200	34,440.00	0.04
840	002869	金溢科技	1,450	34,336.00	0.04
841	603105	芯能科技	3,800	34,238.00	0.04
842	000544	中原环保	5,600	34,104.00	0.04
843	300526	中潜股份	1,021	34,101.40	0.04
844	300634	彩讯股份	1,600	33,984.00	0.04
845	002755	奥赛康	2,500	33,975.00	0.04
846	000791	甘肃电投	7,900	33,970.00	0.04
847	600686	金龙汽车	5,000	33,950.00	0.04
848	600825	新华传媒	7,500	33,750.00	0.04
849	000019	深粮控股	4,600	33,488.00	0.04
850	003012	东鹏控股	2,000	33,280.00	0.04
851	603258	电魂网络	1,300	33,267.00	0.04
852	300791	仙乐健康	600	33,240.00	0.04
853	002959	小熊电器	500	33,220.00	0.04
854	603610	麒盛科技	1,850	33,207.50	0.04
855	300485	赛升药业	2,600	33,176.00	0.04
856	000889	中嘉博创	8,060	33,046.00	0.04
857	002984	森麒麟	900	32,805.00	0.04
858	600929	雪天盐业	5,100	32,793.00	0.04
859	603565	中谷物流	1,100	32,791.00	0.04
860	603299	苏盐井神	4,300	32,680.00	0.04
861	002990	盛视科技	1,000	32,360.00	0.04
862	002562	兄弟科技	7,700	32,340.00	0.04
863	000038	深大通	2,900	32,335.00	0.04

864	605338	巴比食品	1,000	32,330.00	0.04
865	002232	启明信息	2,700	31,914.00	0.04
866	300603	立昂技术	2,900	31,900.00	0.04
867	002746	仙坛股份	4,725	31,799.25	0.04
868	002621	美吉姆	6,020	31,605.00	0.04
869	600996	贵广网络	6,100	31,537.00	0.04
870	300428	立中集团	2,400	31,464.00	0.04
871	300765	新诺威	2,278	31,413.62	0.04
872	603383	顶点软件	1,100	31,273.00	0.03
873	002307	北新路桥	6,900	31,188.00	0.03
874	688019	安集科技	100	31,100.00	0.03
875	300590	移为通信	1,620	31,006.80	0.03
876	603367	辰欣药业	2,500	31,000.00	0.03
877	600876	洛阳玻璃	1,600	30,544.00	0.03
878	002782	可立克	2,600	30,446.00	0.03
879	300867	圣元环保	1,000	30,310.00	0.03
880	002792	通宇通讯	1,850	30,210.50	0.03
881	002978	安宁股份	500	30,210.00	0.03
882	603869	新智认知	3,400	30,124.00	0.03
883	688098	申联生物	2,200	29,942.00	0.03
884	002793	罗欣药业	3,000	29,910.00	0.03
885	603777	来伊份	1,800	29,862.00	0.03
886	603803	瑞斯康达	3,400	29,546.00	0.03
887	002616	长青集团	4,100	29,520.00	0.03
888	600800	渤海化学	6,800	29,444.00	0.03
889	603222	济民医疗	1,800	29,160.00	0.03
890	600746	江苏索普	1,900	29,146.00	0.03
891	300860	锋尚文化	500	29,140.00	0.03
892	603595	东尼电子	1,100	29,073.00	0.03
893	003009	中天火箭	500	29,040.00	0.03
893	300872	天阳科技	800	29,040.00	0.03
894	688177	百奥泰-U	1,100	28,864.00	0.03
895	601595	上海电影	2,460	28,683.60	0.03
896	002181	粤传媒	6,700	28,676.00	0.03
897	002840	华统股份	3,180	28,651.80	0.03
898	000665	湖北广电	7,100	28,542.00	0.03
899	601858	中国科传	3,200	28,512.00	0.03
900	300785	值得买	300	28,500.00	0.03
901	603808	歌力思	1,800	28,440.00	0.03
902	600618	氯碱化工	3,100	28,365.00	0.03
903	603220	中贝通信	2,300	28,244.00	0.03
904	002929	润建股份	1,100	28,182.00	0.03
905	000561	烽火电子	4,200	28,098.00	0.03
906	601116	三江购物	3,000	27,930.00	0.03

907	002941	新疆交建	2,600	27,794.00	0.03
908	000567	海德股份	2,600	27,742.00	0.03
909	002852	道道全	1,900	27,569.00	0.03
910	300209	天泽信息	4,100	27,388.00	0.03
911	603169	兰石重装	6,100	26,962.00	0.03
912	300855	图南股份	700	26,866.00	0.03
913	002880	卫光生物	700	26,852.00	0.03
914	603283	赛腾股份	900	26,478.00	0.03
915	600738	丽尚国潮	4,300	26,273.00	0.03
916	300771	智莱科技	1,080	26,222.40	0.03
917	002987	京北方	820	26,199.00	0.03
918	300900	广联航空	700	26,166.00	0.03
919	603551	奥普家居	2,200	26,136.00	0.03
920	002977	天箭科技	300	25,848.00	0.03
921	002973	侨银股份	1,600	25,488.00	0.03
922	605388	均瑶健康	1,100	25,036.00	0.03
923	002955	鸿合科技	1,280	24,435.20	0.03
924	603053	成都燃气	2,400	24,384.00	0.03
925	000058	深赛格	4,100	24,354.00	0.03
926	688030	山石网科	900	24,300.00	0.03
927	000517	荣安地产	9,100	24,115.00	0.03
928	688108	赛诺医疗	2,200	24,068.00	0.03
929	300800	力合科技	1,200	23,856.00	0.03
930	000025	特力 A	1,600	23,808.00	0.03
931	603360	百傲化学	1,700	23,698.00	0.03
932	002962	五方光电	1,840	23,515.20	0.03
933	603815	交建股份	2,700	23,490.00	0.03
934	300805	电声股份	1,700	23,409.00	0.03
935	603093	南华期货	1,600	23,360.00	0.03
936	002631	德尔未来	3,700	23,162.00	0.03
937	300793	佳禾智能	1,400	22,820.00	0.03
938	002947	恒铭达	840	22,680.00	0.03
939	688268	华特气体	300	22,554.00	0.03
940	603693	江苏新能	1,700	22,474.00	0.03
941	601686	友发集团	2,000	22,320.00	0.02
942	300788	中信出版	600	22,062.00	0.02
943	300799	左江科技	400	21,920.00	0.02
944	688085	三友医疗	500	21,815.00	0.02
945	002287	奇正藏药	800	21,576.00	0.02
946	300842	帝科股份	300	21,204.00	0.02
947	300127	银河磁体	1,200	21,012.00	0.02
948	603508	思维列控	1,040	20,394.40	0.02
949	300856	科思股份	400	20,124.00	0.02
950	300857	协创数据	700	19,544.00	0.02

951	300831	派瑞股份	1,200	19,212.00	0.02
952	603976	正川股份	500	19,010.00	0.02
953	688318	财富趋势	100	18,700.00	0.02
954	688020	方邦股份	200	18,594.00	0.02
955	300559	佳发教育	2,100	18,417.00	0.02
956	002991	甘源食品	300	18,099.00	0.02
957	002895	川恒股份	1,200	18,084.00	0.02
958	605008	长鸿高科	900	17,226.00	0.02
959	605099	共创草坪	400	16,952.00	0.02
960	000666	经纬纺机	2,100	16,737.00	0.02
961	002989	中天精装	500	16,160.00	0.02
962	603212	赛伍技术	500	16,145.00	0.02
963	605168	三人行	100	15,336.00	0.02
964	603839	安正时尚	1,600	15,296.00	0.02
965	603327	福蓉科技	1,000	15,090.00	0.02
966	603103	横店影视	1,000	14,720.00	0.02
967	000927	中国铁物	3,900	14,508.00	0.02
968	002980	华盛昌	400	14,380.00	0.02
969	605199	葫芦娃	500	14,365.00	0.02
970	002911	佛燃能源	1,400	13,146.00	0.01
971	603956	威派格	700	12,810.00	0.01
972	002982	湘佳股份	300	12,795.00	0.01
973	002969	嘉美包装	2,600	12,532.00	0.01
974	605222	起帆电缆	600	12,228.00	0.01
975	605136	丽人丽妆	400	12,172.00	0.01
976	003006	百亚股份	500	11,850.00	0.01
977	688001	华兴源创	300	11,388.00	0.01
978	300846	首都在线	600	10,908.00	0.01
979	002951	金时科技	1,000	10,480.00	0.01
980	603711	香飘飘	600	10,212.00	0.01
981	300798	锦鸡股份	1,100	9,856.00	0.01
982	603013	亚普股份	700	9,506.00	0.01
983	605007	五洲特纸	500	9,415.00	0.01
984	002907	华森制药	700	9,401.00	0.01
985	603992	松霖科技	500	9,180.00	0.01
986	603530	神马电力	500	8,865.00	0.01
987	688222	成都先导	300	8,850.00	0.01
988	603687	大胜达	1,100	8,624.00	0.01
989	603439	贵州三力	500	7,490.00	0.01
990	603408	建霖家居	500	7,410.00	0.01
991	605118	力鼎光电	500	7,160.00	0.01
992	688365	光云科技	300	5,709.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300012	华测检测	802,488.00	1.50
2	300496	中科创达	619,670.00	1.16
3	002568	百润股份	444,293.00	0.83
4	603345	安井食品	390,668.00	0.73
5	002920	德赛西威	338,007.00	0.63
6	000516	国际医学	331,838.00	0.62
7	002402	和而泰	327,476.00	0.61
8	002497	雅化集团	316,478.00	0.59
9	601058	赛轮轮胎	311,502.98	0.58
10	300677	英科医疗	302,140.55	0.56
11	601636	旗滨集团	296,325.00	0.55
12	000799	酒鬼酒	281,254.00	0.53
13	002706	良信股份	259,829.00	0.49
14	600882	妙可蓝多	256,762.00	0.48
15	000733	振华科技	254,606.00	0.48
16	600711	盛屯矿业	252,025.00	0.47
17	000591	太阳能	242,268.00	0.45
18	300390	天华超净	237,246.00	0.44
19	000423	东阿阿胶	237,187.00	0.44
20	002407	多氟多	234,841.00	0.44

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

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	000799	酒鬼酒	942,994.00	1.76
2	601636	旗滨集团	572,326.00	1.07
3	300037	新宙邦	416,220.00	0.78
4	300677	英科医疗	412,962.00	0.77

5	002180	纳思达	380,318.00	0.71
6	600988	赤峰黄金	372,715.00	0.70
7	300251	光线传媒	316,179.00	0.59
8	000516	国际医学	264,332.50	0.49
9	002459	晶澳科技	230,490.00	0.43
10	600882	妙可蓝多	225,520.00	0.42
11	002497	雅化集团	225,151.00	0.42
12	002706	良信股份	219,358.00	0.41
13	002402	和而泰	214,406.00	0.40
14	000591	太阳能	187,071.00	0.35
15	600803	新奥股份	178,972.00	0.33
16	600732	爱旭股份	177,133.00	0.33
17	600499	科达制造	175,861.00	0.33
18	601058	赛轮轮胎	172,350.18	0.32
19	600559	老白干酒	168,335.00	0.31
20	600601	ST 方科	165,513.85	0.31

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	74,785,856.02
卖出股票收入（成交）总额	47,899,107.32

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,087.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	767.89
5	应收申购款	916,635.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	932,490.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
广发中证 1000 指数 A	2,633	11,269.53	10,000,800.08	33.70%	19,671,868.06	66.30%
广发中证 1000 指数 C	4,164	7,124.05	10,023,387.90	33.79%	19,641,135.83	66.21%
合计	6,797	8,729.91	20,024,187.98	33.75%	39,313,003.89	66.25%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发中证 1000 指数 A	6.90	0.0000%
	广发中证 1000 指数 C	0.00	0.0000%
	合计	6.90	0.0000%

8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	广发中证 1000 指数 A	0
	广发中证 1000 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	广发中证 1000 指数 A	0

开放式基金	广发中证 1000 指数 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.0 8	16.85%	10,000,800.0 8	16.85%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.0 8	16.85%	10,000,800.0 8	16.85%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 2 日）基金份额总额	14,265,879.01	5,410,288.42
本报告期期初基金份额总额	24,168,322.52	13,709,474.24
本报告期基金总申购份额	24,759,121.60	73,454,766.60
减：本报告期基金总赎回份额	19,254,775.98	57,499,717.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,672,668.14	29,664,523.73

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	3	122,601,308.74	100.00%	114,099.41	100.00%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
华融证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-

华林证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
华创证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
安信证券	5	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	5	-	-	-	-	-

长城证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

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

2、交易单元选择流程：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
3	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
5	关于广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-17

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	20210101-20210222	10,000,800.08	-	-	10,000,800.08	16.85%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会注册广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

- 4.《广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日