

中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 3 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	143
8.1 期末基金资产组合情况.....	143
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	144
8.3 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.....	145
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	169
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	170

8.6	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	170
8.7	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	171
8.8	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	171
8.9	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	171
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	171
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	172
8.12	投资组合报告附注	172
§9	基金份额持有人信息	173
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	173
9.2	期末上市基金前十名持有人	174
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	174
9.4	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	174
§10	开放式基金份额变动	174
§11	重大事件揭示	175
11.1	基金份额持有人大会决议	175
11.2	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	175
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	175
11.4	基金投资策略的改变	175
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	175
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	175
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	176
11.8	其他重大事件	177
§12	影响投资者决策的其他重要信息	177
12.1	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	177
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	178
§13	备查文件目录	178
13.1	备查文件目录	178
13.2	存放地点	178
13.3	查阅方式	179

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF 或 中证 500ETF
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,803,467,244.00 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	2013 年 3 月 15 日

注：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“500ETF”或“中证 500ETF”。

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 500 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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	0755-82763889	010-68121816

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	北京东城区建国门内大街 69 号
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	张海波	周慕冰

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业 广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	1,835,304,261.54	-3,606,558,298.17	173,967,723.74
本期利润	10,590,464,988.88	-9,667,610,976.05	289,583,290.06
加权平均基金份额本期利润	1.2985	-2.0060	0.1061
本期加权平均净值利润率	24.26%	-37.18%	1.60%
本期基金份额净值增长率	27.91%	-32.27%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	16,702,353,517.17	6,713,365,030.28	8,490,637,067.38
期末可供分配基金份额利润	2.1404	0.8951	3.0209
期末基金资产净值	44,539,669,173.68	33,467,648,130.29	18,517,132,829.56
期末基金份额净值	5.7077	4.4624	6.5882
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	60.00%	25.09%	84.31%

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

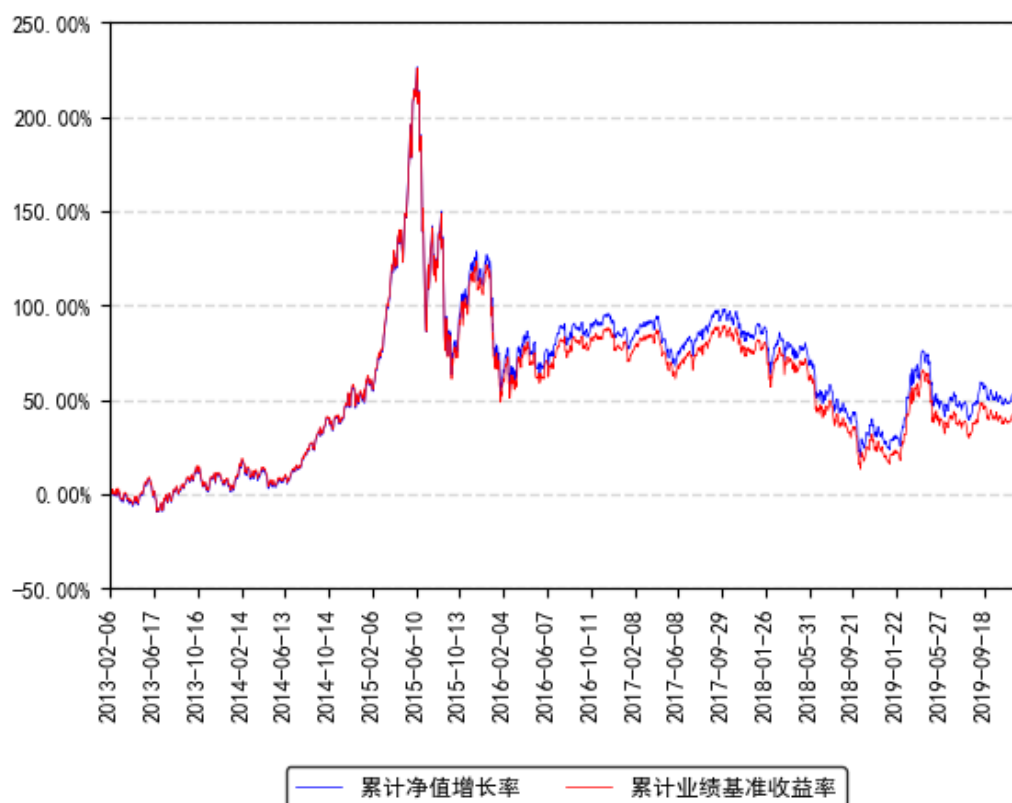
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	6.88%	0.92%	6.61%	0.92%	0.27%	0.00%
过去六个月	7.12%	1.08%	6.41%	1.08%	0.71%	0.00%
过去一年	27.91%	1.47%	26.38%	1.47%	1.53%	0.00%
过去三年	-12.93%	1.33%	-15.90%	1.33%	2.97%	0.00%
过去五年	7.25%	1.84%	-1.03%	1.83%	8.28%	0.01%
自基金合同生效起至今	60.00%	1.71%	48.62%	1.71%	11.38%	0.00%

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

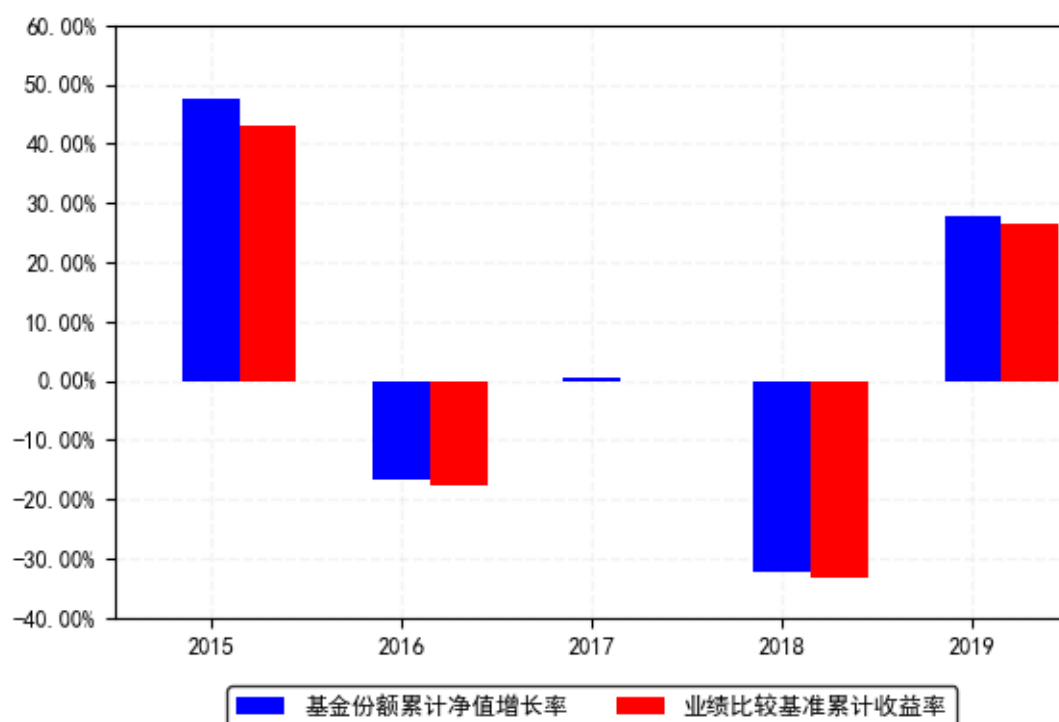
准收益率变动的比较

南方中证500ETF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



3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证500ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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 9200 亿元，旗下管理 204 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	14 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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，两组组合间单日、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。

4.3.3 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8次，由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位和指数成分股调整所致。

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

报告期内，中证 500 指数上涨 26.38%。

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) 大额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；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，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，从实施结果来看，效果良好，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 5.7077 元，报告期内，份额净值增长率为 27.91%，同期业绩基准增长率为 26.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储中周期调整结束，全球经济持续下行，但出现回暖迹象，衰退风险有所下降。国内来看，工业企业利润增速将见底反弹，微观数据显经济回暖迹象，流动性相对宽松。随着国内资本市场加速开放，国际化的进程推进，预期中长期资金持续流入。同时权益市场估值仍为底部区域，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循和落实包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引（试行）》、《关于证券基金期货业反洗钱工作有关事项文件的通知》、《关于公募基金投资科创板股票的通知》等 2019 年发布或实施的新规在内的公

募基金行业法律法规及其他规范要求。本基金管理人坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先行稳致远”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》、《防控内幕信息和交易管理制度》、《反洗钱内部控制制度》、《廉洁从业内部控制制度》、《信息和保密管理制度》、《制度管理规定》、《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在遵循和完善制度机制建设的基础上，本基金管理人积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，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；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；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。

4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 21242 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方中证 500ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>

<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>南方中证 500ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方中证 500ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算南方中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务</p>

	<p>报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞、曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2020 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,220,969,159.36	96,648,049.93
结算备付金		505,851,292.36	1,169,480,366.88
存出保证金		246,214,939.08	244,226,214.29
交易性金融资产	7.4.7.2	42,592,507,448.88	31,929,530,734.12
其中：股票投资		42,548,489,248.88	31,929,530,734.12
基金投资		-	-
债券投资		44,018,200.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	100,000,000.00
应收证券清算款		26,751,157.19	4,346,139.51
应收利息	7.4.7.5	4,575,421.86	791,397.02
应收股利		170,122.96	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		44,597,039,541.69	33,545,022,901.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,352,253.67	34,118,506.26
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		18,632,676.35	14,655,148.66
应付托管费		3,726,535.27	2,931,029.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,448,171.90	2,365,098.60
应交税费		1,630,919.70	77.08
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	25,579,811.12	23,304,911.11
负债合计		57,370,368.01	77,374,771.46
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	27,837,315,656.51	26,754,283,100.01
未分配利润	7.4.7.10	16,702,353,517.17	6,713,365,030.28
所有者权益合计		44,539,669,173.68	33,467,648,130.29
负债和所有者权益总计		44,597,039,541.69	33,545,022,901.75

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.7077 元，基金份额总额 7,803,467,244.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		10,926,282,547.47	-9,476,412,647.11
1. 利息收入		50,373,998.06	18,934,023.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	36,534,822.34	18,148,546.70
债券利息收入		40,769.58	24,113.90
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		10,724,663.42	761,363.14

其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		3,073,742.72	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		2,089,725,864.10	-3,371,793,411.25
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	1,233,182,109.58	-3,414,617,045.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,760,093.04	1,344,841.10
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	298,120,425.63	-224,139,734.60
股利收益	7.4.7.16	550,663,235.85	265,618,528.11
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	8,755,160,727.34	-6,061,052,677.88
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	31,021,957.97	-62,500,581.72
减: 二、费用		335,817,558.59	191,198,328.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	217,649,970.37	129,584,501.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	43,529,994.01	25,916,900.47
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	60,072,353.48	27,323,207.73
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		1,084,446.12	12,106.71
7. 其他费用	7.4.7.20	13,480,794.61	8,361,612.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		10,590,464,988.88	-9,667,610,976.05
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,590,464,988.88	-9,667,610,976.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	26,754,283,100.01	6,713,365,030.28	33,467,648,130.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,590,464,988.88	10,590,464,988.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,083,032,556.50	-601,476,501.99	481,556,054.51
其中：1. 基金申购款	37,562,251,465.64	18,983,225,889.66	56,545,477,355.30
2. 基金赎回款	-36,479,218,909.14	-19,584,702,391.65	-56,063,921,300.79
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)	27,837,315,656.51	16,702,353,517.17	44,539,669,173.68
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	10,026,495,762.18	8,490,637,067.38	18,517,132,829.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,667,610,976.05	-9,667,610,976.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	16,727,787,337.83	7,890,338,938.95	24,618,126,276.78

(净值减少以“—”号填列)			
其中：1. 基金申购款	28,188,811,640.77	13,308,682,987.28	41,497,494,628.05
2. 基金赎回款	-11,461,024,302.94	-5,418,344,048.33	-16,879,368,351.27
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)	26,754,283,100.01	6,713,365,030.28	33,467,648,130.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1727 号《关于核准中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,147,543,632.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,147,553,216.00 份，其中通过基金管理人进行网下现金认购部分的认购资金利息折合 9,584.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债[2013]83 号审核同意，本基金 4,616,093,841.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏

离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股；此外，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，根据《南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定，于 2013 年 2 月 22 日将管理的南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)（以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”）。南方中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2020 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除

在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。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。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够

取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	120,969,159.36	96,648,049.93
定期存款	1,100,000,000.00	-
其中：存款期限 1 个月以内	200,000,000.00	-
存款期限 1-3 个月	900,000,000.00	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,220,969,159.36	96,648,049.93

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,407,148,709.87	42,548,489,248.88	2,141,340,539.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	44,018,200.00	44,018,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	44,018,200.00	44,018,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	40,451,166,909.87	42,592,507,448.88	2,141,340,539.01
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	38,275,908,352.84	31,929,530,734.12	-6,346,377,618.72
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	38,275,908,352.84	31,929,530,734.12	-6,346,377,618.72

注：于 2019 年 12 月 31 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 24,777.00 元(2018 年 12 月 31 日：-78.00 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,832,304,813.14	-	-	-
- 股指期货	1,832,304,813.14	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,832,304,813.14	-	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,675,916,822.75	-	-	-
- 股指期货	1,675,916,822.75	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,675,916,822.75	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2001	IC2001	313 329, 701, 680. 00	25, 080, 626. 86	
IC2003	IC2003	1, 580 1, 653, 185, 600. 00	127, 383, 840. 00	
IC2006	IC2006	2 2, 065, 760. 00	183, 760. 00	
总额合计		1, 895 1, 984, 953, 040. 00	152, 648, 226. 86	
减：可抵销期货暂收款			152, 648, 226. 86	
股指期货投资净额			-	

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
----	----------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-

注：交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	123,399.77	33,149.09
应收定期存款利息	3,061,777.78	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	258,626.79	638,154.15
应收债券利息	5,199.39	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	115,567.68
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	1,122,808.83	-
其他	3,609.30	4,526.10
合计	4,575,421.86	791,397.02

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,448,171.90	2,365,098.60
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,448,171.90	2,365,098.60

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 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	-	-
应退退补款	22,012,741.17	19,873,527.67
预提费用	290,000.00	465,000.00
应付指数使用费	3,261,080.05	2,511,230.64
可退退补款	15,989.90	455,152.80
其他	-	-
合计	25,579,811.12	23,304,911.11

注:1. 可退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时, 替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 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。

7.4.7.9 实收基金

金额单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	7,499,867,244.00	26,754,283,100.01
本期申购	10,529,600,000.00	37,562,251,465.64
本期赎回 (以“-”号填列)	-10,226,000,000.00	-36,479,218,909.14
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	7,803,467,244.00	27,837,315,656.51

7.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,513,040,363.13	-25,799,675,332.85	6,713,365,030.28
本期利润	1,835,304,261.54	8,755,160,727.34	10,590,464,988.88
本期基金份额交易产生的变动数	1,426,678,257.97	-2,028,154,759.96	-601,476,501.99
其中: 基金申购款	47,220,110,355.46	-28,236,884,465.80	18,983,225,889.66
基金赎回款	-45,793,432,097.49	26,208,729,705.84	-19,584,702,391.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,775,022,882.64	-19,072,669,365.47	16,702,353,517.17

7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,424,282.59	1,087,589.04
定期存款利息收入	20,525,527.78	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	11,389,533.35	16,980,212.74
其他	195,478.62	80,744.92
合计	36,534,822.34	18,148,546.70

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	472,765,784.48	-2,479,582,279.20
股票投资收益——赎回差价收入	760,416,325.10	-935,034,766.66
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	1,233,182,109.58	-3,414,617,045.86

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	43,064,229,607.78	17,751,229,378.56
减：卖出股票成本总额	42,591,463,823.30	20,230,811,657.76
买卖股票差价收入	472,765,784.48	-2,479,582,279.20

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	56,063,921,300.79	16,879,368,351.27
减：现金支付赎回款总额	29,205,310,016.79	9,064,908,014.27
减：赎回股票成本总额	26,098,194,958.90	8,749,495,103.66
赎回差价收入	760,416,325.10	-935,034,766.66

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.12.5 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。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	7,760,093.04	1,344,841.10
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	7,760,093.04	1,344,841.10

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	66,178,187.19	74,277,240.77
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	58,381,300.00	72,904,500.00
减：应收利息总额	36,794.15	27,899.67
买卖债券差价收入	7,760,093.04	1,344,841.10

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	298,120,425.63	-224,139,734.60

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	550,663,235.85	265,618,528.11
其中：证券出借权益补偿收入	182,906.65	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	550,663,235.85	265,618,528.11

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	8,487,718,157.73	-5,940,189,010.18
——股票投资	8,487,718,157.73	-5,939,898,937.24
——债券投资	-	-290,072.94
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	267,442,569.61	-120,863,667.70
——权证投资	-	-
——期货投资	267,442,569.61	-120,863,667.70
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	8,755,160,727.34	-6,061,052,677.88

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 24,855.00 元(2018 年度：1,069.00 元)。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	31,021,957.97	-62,500,581.72
合计	31,021,957.97	-62,500,581.72

注：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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	60,072,353.48	27,323,207.73
银行间市场交易费用	-	-
合计	60,072,353.48	27,323,207.73

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	170,000.00	165,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	13,058,998.16	7,775,070.16
银行费用	71,796.45	61,542.34
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	13,480,794.61	8,361,612.50

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，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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“南方中证 500ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

3. 根据《南方基金管理股份有限公司关于公司股东及股东出资比例变更的公告》，经南方基金管理股份有限公司(以下简称“南方基金”)股东大会决议，并经中国证监会证监许可[2019]1361 号《关于核准南方基金管理股份有限公司变更股权的批复》核准，新增厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)和厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)为南方基金的股东，并于 2019 年 7 月 31 日完成了工商变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
-------	-------------------------------------	--

	月 31 日		2018 年 12 月 31 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	60,193,489,392.83	68.22%	22,821,530,869.74	46.61%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	6,020,203.06	68.22%	209,773.84	14.49%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	2,282,428.20	46.61%	1,765,141.79	74.63%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	217,649,970.37	129,584,501.53
其中：支付销售机构的客户维护费	68,149.11	373,887.10

注：支付基金管理人南方基金的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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	43,529,994.01	25,916,900.47
----------------	---------------	---------------

注：支付基金托管人中国农业银行的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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	1,089,978,968.00	938,357.63	599,460,171.00	466,707.39
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	1,579,000.00	0.02%	22,723,900.00	0.30%

兴业证券股份有限公司	100.00	0.00%	-	-
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,877,777,002.00	24.06%	1,366,573,402.00	18.22%
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

注：华泰证券、兴业证券、南方中证 500ETF 联接基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.6 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	120,969,159.36	4,424,282.59	96,648,049.93	1,087,589.04

注：本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
002174	游族网络	2019 年 10 月 28 日	2020 年 4 月 28 日	大宗受限锁定	13.79	21.87	2,371,214	32,699,041.06	51,858,450.18	-
002195	二三四五	2019 年 10 月 23 日	2020 年 4 月 23 日	大宗受限锁定	2.92	3.08	10,000,000	29,200,000.00	30,800,000.00	-
002195	二三四五	2019 年 11 月 19 日	2020 年 5 月 19 日	大宗受限锁定	2.69	3.07	13,000,000	34,970,000.00	39,910,000.00	-

002382	蓝帆医疗	2019 年 8 月 19 日	2020 年 2 月 19 日	大宗受 限锁定	12.02	11.85	500,000	6,010,000.0 0	5,925,000.0 0	-
002382	蓝帆医疗	2019 年 12 月 13 日	2020 年 6 月 15 日	大宗受 限锁定	11.37	11.62	550,000	6,253,500.0 0	6,391,000.0 0	-
002382	蓝帆医疗	2019 年 12 月 17 日	2020 年 6 月 17 日	大宗受 限锁定	11.73	11.62	750,000	8,797,500.0 0	8,715,000.0 0	-
002384	东山精密	2019 年 9 月 6 日	2020 年 3 月 6 日	大宗受 限锁定	20.88	22.24	2,000,00 0	41,760,000. 00	44,480,000. 00	-
002387	维信诺	2019 年 10 月 14 日	2020 年 4 月 14 日	大宗受 限锁定	14.54	15.34	1,800,00 0	26,172,000. 00	27,612,000. 00	-
002387	维信诺	2019 年 12 月 16 日	2020 年 6 月 16 日	大宗受 限锁定	14.63	15.21	1,500,00 0	21,945,000. 00	22,815,000. 00	-
002414	高德红外	2019 年 12 月 5 日	2020 年 6 月 5 日	大宗受 限锁定	18.64	19.89	1,400,00 0	26,096,000. 00	27,846,000. 00	-
002625	光启技术	2019 年 12 月 11 日	2020 年 6 月 11 日	大宗受 限锁定	8.74	8.55	2,370,00 0	20,713,800. 00	20,263,500. 00	-
002681	奋达科技	2019 年 11 月 8 日	2020 年 5 月 8 日	大宗受 限锁定	3.97	5.14	4,000,00 0	15,880,000. 00	20,560,000. 00	-
002797	第一创业	2019 年 9 月 3 日	2020 年 3 月 3 日	大宗受 限锁定	5.87	7.97	7,500,00 0	44,025,000. 00	59,775,000. 00	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未 上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
003816	中国广核	2019 年 8 月 14 日	2020 年 2 月 27 日	新股锁 定期	2.49	3.53	562,958	1,401,765.4 2	1,987,241.7 4	-
300324	旋极信息	2019 年 12 月 12 日	2020 年 6 月 12 日	大宗受 限锁定	4.73	5.21	5,000,00 0	23,650,000. 00	26,050,000. 00	-
600545	卓郎智能	2019 年 10 月 14 日	2020 年 4 月 14 日	大宗受 限锁定	6.93	5.90	1,809,90 0	12,542,607. 00	10,678,410. 00	-
600754	锦江酒店	2019 年	2020 年	大宗受	22.60	27.85	880,000	19,888,000.	24,508,000.	-

		9月11日	3月11日	限锁定				00	00	
600909	华安证券	2019年12月30日	2020年6月30日	大宗受限锁定	6.30	6.95	4,300,000	27,090,000.00	29,885,000.00	-
603328	依顿电子	2019年9月20日	2020年3月20日	大宗受限锁定	12.08	10.91	1,500,000	18,120,000.00	16,365,000.00	-
603650	彤程新材	2019年12月12日	2020年6月12日	大宗受限锁定	14.89	16.65	450,000	6,700,500.00	7,492,500.00	-
688009	中国通号	2019年7月12日	2020年1月22日	科创板新股锁定期	5.85	6.79	1,540,000	9,009,000.00	10,456,600.00	-
688019	安集科技	2019年7月12日	2020年1月22日	科创板新股锁定期	39.19	128.06	4,378	171,573.82	560,646.68	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新股未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
688369	致远互联	2019年10月23日	2020年5月6日	科创板新股锁定期	49.39	52.08	2,970	146,688.30	154,677.60	-

7.4.12.1.2 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
110063	鹰19转债	2019年12月16日	2020年1月3日	配债未上市	100.00	100.00	140,160	14,016,000.00	14,016,000.00	-
110064	建工转债	2019年12月23日	2020年1月16日	配债未上市	100.00	100.00	36,870	3,687,000.00	3,687,000.00	-
110065	淮矿转债	2019年12月24日	2020年1月13日	配债未上市	100.00	100.00	50,190	5,019,000.00	5,019,000.00	-
113029	明阳转债	2019年12月17日	2020年1月7日	配债未上市	100.00	100.00	34,570	3,457,000.00	3,457,000.00	-
123036	先导转债	2019年12月11日	2020年1月10日	配债未上市	100.00	100.00	47,978	4,797,800.00	4,797,800.00	-

		日	日							
128086	国轩转债	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 10 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	130,414	13,041,400. 00	13,041,400. 00	-

注：

1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值 总额
20191212 00000052	000006	深振业 A	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	5.36	20,000.00	107,200.0 0
20191218 00000060	000006	深振业 A	2019 年 12 月 18	2020 年 1 月 2 日	5.36	28,700.00	153,832.0 0

			日				
20191219 00000084	000006	深振业 A	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.36	51,300.00	274,968.0 0
20191218 00000056	000008	神州高铁	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	3.63	27,100.00	98,373.00
20191218 00000050	000008	神州高铁	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.63	105,000.0 0	381,150.0 0
20191218 00000054	000009	中国宝安	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.19	137,300.0 0	849,887.0 0
20191226 00000055	000009	中国宝安	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	6.19	1,000,000 .00	6,190,000 .00
20191226 00000067	000009	中国宝安	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	6.19	709,000.0 0	4,388,710 .00
20191227 00000039	000009	中国宝安	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	6.19	676,000.0 0	4,184,440 .00
20191227 00000042	000009	中国宝安	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	6.19	266,000.0 0	1,646,540 .00
20191227 00000045	000009	中国宝安	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	6.19	600,000.0 0	3,714,000 .00
20191227 00000033	000009	中国宝安	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	6.19	408,000.0 0	2,525,520 .00
20191227 00000035	000009	中国宝安	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	6.19	400,000.0 0	2,476,000 .00
20191227 00000044	000009	中国宝安	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	6.19	890,000.0 0	5,509,100 .00
20191218 00000049	000012	南 玻 A	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.01	74,400.00	372,744.0 0
20191218 00000052	000012	南 玻 A	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.01	15,300.00	76,653.00
20191204	000021	深 科 技	2019 年	2020 年 1	12.18	60,000.00	730,800.0

00000114			12月4日	月2日			0
20191206 00000046	000021	深科技	2019年 12月6日	2020年1 月3日	12.18	360,000.0 0	4,384,800 .00
20191211 00000141	000021	深科技	2019年 12月11 日	2020年1 月8日	12.18	150,000.0 0	1,827,000 .00
20191213 00000035	000021	深科技	2019年 12月13 日	2020年1 月10日	12.18	90,000.00	1,096,200 .00
20191217 00000018	000021	深科技	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	12.18	95,000.00	1,157,100 .00
20191217 00000020	000021	深科技	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	12.18	50,000.00	609,000.0 0
20191217 00000023	000021	深科技	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	12.18	36,800.00	448,224.0 0
20191218 00000062	000021	深科技	2019年 12月18 日	2020年1 月2日	12.18	60,000.00	730,800.0 0
20191219 00000098	000021	深科技	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	12.18	70,000.00	852,600.0 0
20191220 00000031	000021	深科技	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	12.18	100,000.0 0	1,218,000 .00
20191225 00000091	000021	深科技	2019年 12月25 日	2020年1 月22日	12.18	85,000.00	1,035,300 .00
20191217 00000031	000025	特力A	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	21.20	10,000.00	212,000.0 0
20191220 00000026	000025	特力A	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	21.20	30,000.00	636,000.0 0
20191220 00000032	000025	特力A	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	21.20	90,000.00	1,908,000 .00
20191220 00000034	000025	特力A	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	21.20	20,000.00	424,000.0 0
20191220 00000043	000025	特力A	2019年 12月20	2020年1 月17日	21.20	10,000.00	212,000.0 0

			日				
20191218 00000058	000027	深圳能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.21	65,100.00	404,271.0 0
20191219 00000095	000028	国药一致	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	45.36	10,000.00	453,600.0 0
20191223 00000113	000028	国药一致	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	45.36	70,000.00	3,175,200 .00
20191218 00000055	000031	大悦城	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.18	64,900.00	465,982.0 0
20191220 00000029	000031	大悦城	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	7.18	13,900.00	99,802.00
20191218 00000057	000039	中集集团	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.82	56,600.00	555,812.0 0
20191218 00000053	000050	深天马 A	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	16.29	54,200.00	882,918.0 0
20191227 00000056	000050	深天马 A	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	16.29	15,900.00	259,011.0 0
20191218 00000051	000060	中金岭南	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.30	134,300.0 0	577,490.0 0
20191217 00000030	000061	农产品	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	5.59	36,500.00	204,035.0 0
20191219 00000097	000062	深圳华强	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	14.24	16,300.00	232,112.0 0
20191204 00000112	000066	中国长城	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	15.56	600,000.0 0	9,336,000 .00
20191205 00000078	000066	中国长城	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	15.56	120,000.0 0	1,867,200 .00
20191205 00000088	000066	中国长城	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	15.56	100,000.0 0	1,556,000 .00
20191209 00000111	000066	中国长城	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	15.56	200,000.0 0	3,112,000 .00
20191210 00000204	000066	中国长城	2019 年 12 月 10	2020 年 1 月 7 日	15.56	80,000.00	1,244,800 .00

			日				
20191210 00000208	000066	中国长城	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	15.56	40,000.00	622,400.0 0
20191211 00000151	000066	中国长城	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	15.56	740,000.0 0	11,514,40 0.00
20191212 00000046	000066	中国长城	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.56	30,000.00	466,800.0 0
20191212 00000051	000066	中国长城	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.56	250,000.0 0	3,890,000 .00
20191213 00000033	000066	中国长城	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.56	40,000.00	622,400.0 0
20191213 00000036	000066	中国长城	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.56	70,000.00	1,089,200 .00
20191213 00000037	000066	中国长城	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.56	160,000.0 0	2,489,600 .00
20191217 00000025	000066	中国长城	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.56	57,000.00	886,920.0 0
20191217 00000027	000066	中国长城	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.56	100,000.0 0	1,556,000 .00
20191217 00000028	000066	中国长城	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.56	50,000.00	778,000.0 0
20191219 00000092	000066	中国长城	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	15.56	10,000.00	155,600.0 0
20191219 00000088	000066	中国长城	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	15.56	44,000.00	684,640.0 0
20191224 00000078	000066	中国长城	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	15.56	10,000.00	155,600.0 0
20191224 00000089	000066	中国长城	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	15.56	10,000.00	155,600.0 0
20191226	000066	中国长城	2019 年	2020 年 1	15.56	40,000.00	622,400.0

00000060			12月26日	月23日			0
20191218 00000061	000078	海王生物	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.73	91,700.00	342,041.0 0
20191213 00000058	000089	深圳机场	2019年 12月13日	2020年1 月10日	9.77	138,500.0 0	1,353,145 .00
20191218 00000059	000089	深圳机场	2019年 12月18日	2020年1 月15日	9.77	56,900.00	555,913.0 0
20191218 00000065	000090	天健集团	2019年 12月18日	2020年1 月2日	5.30	19,100.00	101,230.0 0
20191218 00000064	000090	天健集团	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.30	71,000.00	376,300.0 0
20191217 00000035	000156	华数传媒	2019年 12月17日	2020年1 月14日	10.44	30,400.00	317,376.0 0
20191218 00000066	000156	华数传媒	2019年 12月18日	2020年1 月2日	10.44	120,000.0 0	1,252,800 .00
20191218 00000071	000156	华数传媒	2019年 12月18日	2020年1 月2日	10.44	200,000.0 0	2,088,000 .00
20191218 00000073	000156	华数传媒	2019年 12月18日	2020年1 月15日	10.44	810,000.0 0	8,456,400 .00
20191223 00000107	000156	华数传媒	2019年 12月23日	2020年1 月20日	10.44	70,000.00	730,800.0 0
20191206 00000049	000158	常山北明	2019年 12月6日	2020年1 月3日	6.82	150,000.0 0	1,023,000 .00
20191211 00000143	000158	常山北明	2019年 12月11日	2020年1 月8日	6.82	363,000.0 0	2,475,660 .00
20191211 00000148	000158	常山北明	2019年 12月11日	2020年1 月8日	6.82	10,000.00	68,200.00
20191211 00000152	000158	常山北明	2019年 12月11日	2020年1 月8日	6.82	30,000.00	204,600.0 0
20191212	000158	常山北明	2019年	2020年1	6.82	47,500.00	323,950.0

00000054			12 月 12 日	月 9 日			0
20191212 00000056	000158	常山北明	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	6.82	300,000.0 0	2,046,000 .00
20191217 00000038	000158	常山北明	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.82	161,000.0 0	1,098,020 .00
20191218 00000067	000158	常山北明	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	6.82	15,600.00	106,392.0 0
20191218 00000068	000158	常山北明	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.82	51,000.00	347,820.0 0
20191218 00000072	000158	常山北明	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.82	286,600.0 0	1,954,612 .00
20191218 00000075	000158	常山北明	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.82	46,800.00	319,176.0 0
20191220 00000027	000158	常山北明	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	6.82	40,000.00	272,800.0 0
20191220 00000039	000158	常山北明	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	6.82	20,000.00	136,400.0 0
20191226 00000063	000158	常山北明	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	6.82	30,000.00	204,600.0 0
20191226 00000065	000158	常山北明	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	6.82	100,000.0 0	682,000.0 0
20191218 00000069	000301	东方盛虹	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	5.18	19,300.00	99,974.00
20191218 00000074	000301	东方盛虹	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.18	65,100.00	337,218.0 0
20191217 00000042	000400	许继电气	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.77	31,900.00	343,563.0 0
20191219 00000089	000401	冀东水泥	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	17.01	200,000.0 0	3,402,000 .00

20191219 00000091	000401	冀东水泥	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	17.01	51,900.00	882,819.0 0
20191218 00000070	000402	金 融 街	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.12	65,000.00	527,800.0 0
20191205 00000086	000426	兴业矿业	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	4.97	260,000.0 0	1,292,200 .00
20191206 00000045	000426	兴业矿业	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	4.97	280,000.0 0	1,391,600 .00
20191212 00000055	000426	兴业矿业	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	4.97	143,700.0 0	714,189.0 0
20191217 00000044	000426	兴业矿业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	4.97	36,400.00	180,908.0 0
20191220 00000041	000426	兴业矿业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	4.97	21,400.00	106,358.0 0
20191218 00000080	000488	晨鸣纸业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.09	75,700.00	385,313.0 0
20191217 00000053	000501	鄂武商 A	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.28	23,500.00	312,080.0 0
20191227 00000075	000501	鄂武商 A	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	13.28	36,000.00	478,080.0 0
20191210 00000225	000513	丽珠集团	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	33.70	32,000.00	1,078,400 .00
20191211 00000161	000513	丽珠集团	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	33.70	32,000.00	1,078,400 .00
20191217 00000043	000513	丽珠集团	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	33.70	63,000.00	2,123,100 .00
20191204 00000107	000519	中兵红箭	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	7.62	70,000.00	533,400.0 0
20191205 00000093	000519	中兵红箭	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	7.62	150,000.0 0	1,143,000 .00
20191212 00000050	000519	中兵红箭	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	7.62	57,000.00	434,340.0 0

20191217 00000046	000519	中兵红箭	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	7.62	38,200.00	291,084.0 0
20191220 00000042	000519	中兵红箭	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	7.62	107,000.0 0	815,340.0 0
20191227 00000073	000519	中兵红箭	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	7.62	43,600.00	332,232.0 0
20191218 00000079	000528	柳 工	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.94	54,800.00	380,312.0 0
20191209 00000133	000536	华映科技	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	2.70	420,000.0 0	1,134,000 .00
20191217 00000045	000536	华映科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	2.70	200,000.0 0	540,000.0 0
20191217 00000047	000536	华映科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	2.70	160,000.0 0	432,000.0 0
20191212 00000053	000537	广宇发展	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	7.77	20,000.00	155,400.0 0
20191217 00000054	000537	广宇发展	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	7.77	29,300.00	227,661.0 0
20191227 00000083	000537	广宇发展	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	7.77	61,400.00	477,078.0 0
20191227 00000081	000537	广宇发展	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	7.77	51,000.00	396,270.0 0
20191213 00000060	000543	皖能电力	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	4.64	26,700.00	123,888.0 0
20191218 00000084	000543	皖能电力	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.64	65,100.00	302,064.0 0
20191223 00000111	000543	皖能电力	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	4.64	650,000.0 0	3,016,000 .00
20191218 00000081	000547	航天发展	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.22	58,900.00	601,958.0 0

20191218 00000087	000559	万向钱潮	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.37	75,000.00	402,750.0 0
20191218 00000088	000563	陕国投 A	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.43	105,500.0 0	467,365.0 0
20191217 00000050	000581	威孚高科	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.05	31,700.00	603,885.0 0
20191219 00000087	000581	威孚高科	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	19.05	170,000.0 0	3,238,500 .00
20191218 00000089	000598	兴蓉环境	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.63	98,300.00	455,129.0 0
20191220 00000045	000598	兴蓉环境	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	4.63	21,500.00	99,545.00
20191219 00000086	000600	建投能源	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	4.89	41,500.00	202,935.0 0
20191219 00000093	000623	吉林敖东	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	16.53	49,900.00	824,847.0 0
20191205 00000101	000636	风华高科	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	14.89	100,000.0 0	1,489,000 .00
20191209 00000143	000636	风华高科	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	14.89	70,000.00	1,042,300 .00
20191209 00000145	000636	风华高科	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	14.89	160,000.0 0	2,382,400 .00
20191210 00000241	000636	风华高科	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	14.89	40,000.00	595,600.0 0
20191211 00000165	000636	风华高科	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	14.89	103,700.0 0	1,544,093 .00
20191212 00000057	000636	风华高科	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	14.89	80,000.00	1,191,200 .00
20191217 00000051	000636	风华高科	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	14.89	36,700.00	546,463.0 0
20191219 00000099	000636	风华高科	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	14.89	210,000.0 0	3,126,900 .00

			日				
20191227 00000098	000636	风华高科	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	14.89	10,000.00	148,900.0 0
20191227 00000099	000636	风华高科	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	14.89	35,000.00	521,150.0 0
20191212 00000048	000681	视觉中国	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	17.24	220,000.0 0	3,792,800 .00
20191212 00000058	000681	视觉中国	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	17.24	150,000.0 0	2,586,000 .00
20191212 00000059	000681	视觉中国	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	17.24	60,000.00	1,034,400 .00
20191217 00000058	000681	视觉中国	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	17.24	50,000.00	862,000.0 0
20191217 00000060	000681	视觉中国	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	17.24	24,900.00	429,276.0 0
20191227 00000100	000681	视觉中国	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	17.24	20,000.00	344,800.0 0
20191219 00000107	000685	中山公用	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	8.24	47,300.00	389,752.0 0
20191218 00000091	000686	东北证券	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.30	73,900.00	687,270.0 0
20191223 00000122	000686	东北证券	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	9.30	350,000.0 0	3,255,000 .00
20191218 00000093	000690	宝新能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.65	97,900.00	553,135.0 0
20191211 00000169	000712	锦龙股份	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	15.20	220,000.0 0	3,344,000 .00
20191212 00000060	000712	锦龙股份	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.20	25,000.00	380,000.0 0
20191213	000712	锦龙股份	2019 年	2020 年 1	15.20	76,400.00	1,161,280

00000039			12月13日	月10日			.00
20191217 00000059	000712	锦龙股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	15.20	24,000.00	364,800.0 0
20191220 00000048	000712	锦龙股份	2019年 12月20日	2020年1 月17日	15.20	98,900.00	1,503,280 .00
20191224 00000091	000712	锦龙股份	2019年 12月24日	2020年1 月21日	15.20	30,000.00	456,000.0 0
20191204 00000124	000717	韶钢松山	2019年 12月4日	2020年1 月2日	4.74	110,000.0 0	521,400.0 0
20191217 00000063	000717	韶钢松山	2019年 12月17日	2020年1 月14日	4.74	130,000.0 0	616,200.0 0
20191217 00000064	000717	韶钢松山	2019年 12月17日	2020年1 月14日	4.74	130,000.0 0	616,200.0 0
20191217 00000065	000717	韶钢松山	2019年 12月17日	2020年1 月14日	4.74	210,000.0 0	995,400.0 0
20191217 00000066	000717	韶钢松山	2019年 12月17日	2020年1 月14日	4.74	130,000.0 0	616,200.0 0
20191217 00000073	000717	韶钢松山	2019年 12月17日	2020年1 月14日	4.74	170,000.0 0	805,800.0 0
20191218 00000094	000718	苏宁环球	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.82	82,100.00	313,622.0 0
20191209 00000152	000727	华东科技	2019年 12月9日	2020年1 月6日	2.09	1,000,000 .00	2,090,000 .00
20191209 00000165	000727	华东科技	2019年 12月9日	2020年1 月6日	2.09	500,000.0 0	1,045,000 .00
20191212 00000061	000727	华东科技	2019年 12月12日	2020年1 月9日	2.09	100,000.0 0	209,000.0 0
20191218 00000095	000727	华东科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	2.09	146,600.0 0	306,394.0 0
20191220 00000049	000727	华东科技	2019年 12月20日	2020年1 月17日	2.09	200,000.0 0	418,000.0 0

20191220 00000050	000727	华东科技	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	2.09	1,000,000 .00	2,090,000 .00
20191220 00000051	000727	华东科技	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	2.09	40,000.00	83,600.00
20191218 00000103	000729	燕京啤酒	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.52	75,300.00	490,956.0 0
20191223 00000125	000729	燕京啤酒	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	6.52	480,000.0 0	3,129,600 .00
20191218 00000104	000732	泰禾集团	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.15	54,300.00	333,945.0 0
20191219 00000109	000732	泰禾集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	6.15	160,000.0 0	984,000.0 0
20191217 00000090	000738	航发控制	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.07	31,200.00	407,784.0 0
20191224 00000101	000738	航发控制	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	13.07	10,000.00	130,700.0 0
20191218 00000105	000750	国海证券	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	5.34	19,600.00	104,664.0 0
20191218 00000110	000750	国海证券	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.34	157,000.0 0	838,380.0 0
20191219 00000115	000750	国海证券	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	5.34	29,000.00	154,860.0 0
20191219 00000113	000750	国海证券	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.34	12,400.00	66,216.00
20191227 00000110	000750	国海证券	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	5.34	100,000.0 0	534,000.0 0
20191227 00000112	000750	国海证券	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	5.34	52,200.00	278,748.0 0
20191218 00000109	000758	中色股份	2019 年 12 月 18	2020 年 1 月 15 日	4.38	75,200.00	329,376.0 0

			日				
20191218 00000114	000761	本钢板材	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.94	72,000.00	283,680.0 0
20191217 00000095	000766	通化金马	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.54	33,100.00	216,474.0 0
20191218 00000112	000766	通化金马	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	6.54	15,200.00	99,408.00
20191226 00000072	000766	通化金马	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	6.54	78,000.00	510,120.0 0
20191218 00000115	000778	新兴铸管	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.17	150,800.0 0	628,836.0 0
20191218 00000118	000807	云铝股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.14	82,300.00	423,022.0 0
20191218 00000119	000813	德展健康	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	6.29	16,200.00	101,898.0 0
20191219 00000119	000813	德展健康	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	6.29	49,500.00	311,355.0 0
20191226 00000073	000813	德展健康	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	6.29	10,000.00	62,900.00
20191218 00000122	000825	太钢不锈	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.09	123,900.0 0	506,751.0 0
20191217 00000098	000826	启迪环境	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	9.18	38,900.00	357,102.0 0
20191218 00000125	000826	启迪环境	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	9.18	17,200.00	157,896.0 0
20191219 00000118	000826	启迪环境	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	9.18	17,000.00	156,060.0 0
20191220 00000052	000826	启迪环境	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	9.18	11,100.00	101,898.0 0
20191212	000830	鲁西化工	2019 年	2020 年 1	10.51	32,000.00	336,320.0

00000065			12月12日	月9日			0
20191218 00000126	000830	鲁西化工	2019年 12月18日	2020年1 月2日	10.51	15,900.00	167,109.0 0
20191218 00000130	000830	鲁西化工	2019年 12月18日	2020年1 月15日	10.51	55,300.00	581,203.0 0
20191226 00000074	000830	鲁西化工	2019年 12月26日	2020年1 月9日	10.51	26,800.00	281,668.0 0
20191217 00000094	000848	承德露露	2019年 12月17日	2020年1 月14日	7.87	32,100.00	252,627.0 0
20191219 00000120	000869	张裕A	2019年 12月19日	2020年1 月16日	28.70	10,000.00	287,000.0 0
20191217 00000100	000877	天山股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	11.85	34,400.00	407,640.0 0
20191219 00000122	000878	云南铜业	2019年 12月19日	2020年1 月16日	13.66	43,700.00	596,942.0 0
20191225 00000094	000878	云南铜业	2019年 12月25日	2020年1 月22日	13.66	50,000.00	683,000.0 0
20191227 00000133	000878	云南铜业	2019年 12月27日	2020年2 月3日	13.66	100,000.0 0	1,366,000 .00
20191218 00000129	000883	湖北能源	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.17	107,300.0 0	447,441.0 0
20191219 00000123	000887	中鼎股份	2019年 12月19日	2020年1 月16日	9.05	40,000.00	362,000.0 0
20191218 00000139	000930	中粮科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	6.60	61,900.00	408,540.0 0
20191218 00000133	000932	华菱钢铁	2019年 12月18日	2020年1 月2日	4.78	21,000.00	100,380.0 0
20191218 00000134	000932	华菱钢铁	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.78	90,700.00	433,546.0 0

20191218 00000135	000937	冀中能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.66	58,600.00	214,476.0 0
20191212 00000067	000959	首钢股份	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	3.53	85,400.00	301,462.0 0
20191218 00000128	000959	首钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.53	84,700.00	298,991.0 0
20191218 00000136	000959	首钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.53	86,800.00	306,404.0 0
20191218 00000137	000960	锡业股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.44	52,600.00	549,144.0 0
20191219 00000125	000967	盈峰环境	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	6.17	48,600.00	299,862.0 0
20191219 00000126	000970	中科三环	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.75	45,600.00	490,200.0 0
20191223 00000133	000970	中科三环	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	10.75	40,000.00	430,000.0 0
20191227 00000142	000970	中科三环	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	10.75	14,000.00	150,500.0 0
20191205 00000116	000975	银泰黄金	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	13.61	82,000.00	1,116,020 .00
20191211 00000189	000975	银泰黄金	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	13.61	10,000.00	136,100.0 0
20191218 00000132	000975	银泰黄金	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	13.61	52,300.00	711,803.0 0
20191218 00000140	000980	众泰汽车	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.93	69,300.00	203,049.0 0
20191220 00000054	000980	众泰汽车	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	2.93	600,000.0 0	1,758,000 .00
20191220 00000055	000980	众泰汽车	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	2.93	800,000.0 0	2,344,000 .00

20191220 00000056	000980	众泰汽车	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	2.93	340,000.0 0	996,200.0 0
20191218 00000138	000983	西山煤电	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.13	87,400.00	535,762.0 0
20191217 00000101	000987	越秀金控	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	9.67	782,000.0 0	7,561,940 .00
20191217 00000102	000987	越秀金控	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	9.67	70,000.00	676,900.0 0
20191217 00000103	000987	越秀金控	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	9.67	27,100.00	262,057.0 0
20191220 00000057	000987	越秀金控	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	9.67	30,000.00	290,100.0 0
20191220 00000066	000987	越秀金控	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	9.67	10,400.00	100,568.0 0
20191219 00000134	000988	华工科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	20.29	40,500.00	821,745.0 0
20191211 00000190	000990	诚志股份	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	14.82	480,000.0 0	7,113,600 .00
20191217 00000104	000990	诚志股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	14.82	20,000.00	296,400.0 0
20191224 00000117	000990	诚志股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	14.82	10,000.00	148,200.0 0
20191217 00000105	000997	新大陆	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.88	38,700.00	614,556.0 0
20191218 00000141	000998	隆平高科	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	14.71	23,800.00	350,098.0 0
20191219 00000132	000998	隆平高科	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	14.71	51,000.00	750,210.0 0
20191227 00000151	000998	隆平高科	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	14.71	12,000.00	176,520.0 0

			日				
20191217 00000106	000999	华润三九	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	31.68	21,400.00	677,952.0 0
20191219 00000133	001872	招商港口	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	17.16	10,000.00	171,600.0 0
20191212 00000068	002002	鸿达兴业	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	4.16	125,000.0 0	520,000.0 0
20191217 00000107	002002	鸿达兴业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	4.16	245,700.0 0	1,022,112 .00
20191218 00000149	002002	鸿达兴业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	4.16	24,200.00	100,672.0 0
20191218 00000150	002002	鸿达兴业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.16	84,000.00	349,440.0 0
20191218 00000142	002004	华邦健康	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.94	86,200.00	425,828.0 0
20191219 00000139	002004	华邦健康	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	4.94	60,400.00	298,376.0 0
20191218 00000143	002013	中航机电	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.94	95,000.00	659,300.0 0
20191217 00000108	002019	亿帆医药	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	16.25	66,000.00	1,072,500 .00
20191217 00000110	002019	亿帆医药	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	16.25	37,400.00	607,750.0 0
20191217 00000111	002028	思源电气	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.77	34,500.00	475,065.0 0
20191217 00000112	002030	达安基因	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	11.50	30,700.00	353,050.0 0
20191226 00000077	002030	达安基因	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	11.50	10,000.00	115,000.0 0
20191217	002038	双鹭药业	2019 年	2020 年 1	13.15	34,200.00	449,730.0

00000120			12月17日	月14日			0
20191226 00000079	002038	双鹭药业	2019年 12月26日	2020年1 月9日	13.15	10,000.00	131,500.0 0
20191217 00000119	002048	宁波华翔	2019年 12月17日	2020年1 月14日	15.46	28,200.00	435,972.0 0
20191226 00000078	002048	宁波华翔	2019年 12月26日	2020年1 月23日	15.46	48,200.00	745,172.0 0
20191206 00000088	002049	紫光国微	2019年 12月6日	2020年1 月3日	50.84	30,000.00	1,525,200 .00
20191209 00000192	002049	紫光国微	2019年 12月9日	2020年1 月6日	50.84	62,000.00	3,152,080 .00
20191210 00000312	002049	紫光国微	2019年 12月10日	2020年1 月7日	50.84	20,000.00	1,016,800 .00
20191213 00000048	002049	紫光国微	2019年 12月13日	2020年1 月10日	50.84	27,000.00	1,372,680 .00
20191217 00000118	002049	紫光国微	2019年 12月17日	2020年1 月14日	50.84	21,000.00	1,067,640 .00
20191217 00000117	002051	中工国际	2019年 12月17日	2020年1 月14日	9.72	26,200.00	254,664.0 0
20191218 00000146	002051	中工国际	2019年 12月18日	2020年1 月2日	9.72	10,300.00	100,116.0 0
20191219 00000138	002056	横店东磁	2019年 12月19日	2020年1 月16日	8.20	42,900.00	351,780.0 0
20191218 00000147	002064	华峰氨纶	2019年 12月18日	2020年1 月15日	6.25	12,200.00	76,250.00
20191218 00000148	002064	华峰氨纶	2019年 12月18日	2020年1 月15日	6.25	61,300.00	383,125.0 0
20191218 00000151	002065	东华软件	2019年 12月18日	2020年1 月15日	10.32	90,700.00	936,024.0 0
20191223 00000149	002065	东华软件	2019年 12月23日	2020年1 月20日	10.32	100,000.0 0	1,032,000 .00

			日				
20191225 00000103	002065	东华软件	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	10.32	11,300.00	116,616.0 0
20191226 00000088	002065	东华软件	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	10.32	10,000.00	103,200.0 0
20191212 00000071	002074	国轩高科	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	14.55	24,500.00	356,475.0 0
20191218 00000152	002074	国轩高科	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	14.55	22,400.00	325,920.0 0
20191219 00000143	002074	国轩高科	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	14.55	41,400.00	602,370.0 0
20191209 00000205	002075	沙钢股份	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	6.23	130,000.0 0	809,900.0 0
20191218 00000161	002075	沙钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.23	97,500.00	607,425.0 0
20191220 00000067	002075	沙钢股份	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	6.23	15,400.00	95,942.00
20191218 00000162	002078	太阳纸业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.84	84,000.00	826,560.0 0
20191225 00000099	002078	太阳纸业	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	9.84	111,000.0 0	1,092,240 .00
20191218 00000156	002085	万丰奥威	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.00	70,100.00	490,700.0 0
20191218 00000157	002092	中泰化学	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.79	96,200.00	653,198.0 0
20191220 00000060	002092	中泰化学	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	6.79	15,100.00	102,529.0 0
20191217 00000129	002093	国脉科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	8.06	26,800.00	216,008.0 0
20191218 00000158	002110	三钢闽光	2019 年 12 月 18	2020 年 1 月 15 日	9.36	65,000.00	608,400.0 0

			日				
20191223 00000152	002110	三钢闽光	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	9.36	113,000.0 0	1,057,680 .00
20191225 00000104	002110	三钢闽光	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	9.36	113,000.0 0	1,057,680 .00
20191204 00000139	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	6.24	460,000.0 0	2,870,400 .00
20191210 00000322	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	6.24	80,000.00	499,200.0 0
20191212 00000072	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	6.24	222,000.0 0	1,385,280 .00
20191213 00000050	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	6.24	50,000.00	312,000.0 0
20191213 00000066	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	6.24	180,100.0 0	1,123,824 .00
20191217 00000124	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.24	212,200.0 0	1,324,128 .00
20191218 00000165	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	6.24	48,300.00	301,392.0 0
20191220 00000071	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	6.24	50,000.00	312,000.0 0
20191220 00000061	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	6.24	210,000.0 0	1,310,400 .00
20191220 00000070	002118	紫鑫药业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	6.24	50,000.00	312,000.0 0
20191218 00000175	002127	南极电商	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.91	97,800.00	1,066,998 .00
20191217 00000126	002128	露天煤业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	8.66	31,700.00	274,522.0 0
20191218 00000168	002129	中环股份	2019 年 12 月 18	2020 年 1 月 15 日	11.81	82,900.00	979,049.0 0

			日				
20191204 00000137	002131	利欧股份	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	2.97	1,000,000 .00	2,970,000 .00
20191218 00000167	002131	利欧股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.97	260,800.0 0	774,576.0 0
20191218 00000176	002131	利欧股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.97	500,000.0 0	1,485,000 .00
20191219 00000142	002131	利欧股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	2.97	561,000.0 0	1,666,170 .00
20191220 00000063	002131	利欧股份	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	2.97	39,300.00	116,721.0 0
20191223 00000157	002131	利欧股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 6 日	2.97	200,000.0 0	594,000.0 0
20191223 00000156	002131	利欧股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	2.97	200,000.0 0	594,000.0 0
20191223 00000158	002131	利欧股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	2.97	869,000.0 0	2,580,930 .00
20191223 00000159	002131	利欧股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	2.97	80,000.00	237,600.0 0
20191224 00000112	002131	利欧股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 7 日	2.97	600,000.0 0	1,782,000 .00
20191224 00000115	002131	利欧股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	2.97	960,000.0 0	2,851,200 .00
20191224 00000116	002131	利欧股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	2.97	778,000.0 0	2,310,660 .00
20191224 00000121	002131	利欧股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	2.97	990,000.0 0	2,940,300 .00
20191224 00000123	002131	利欧股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	2.97	1,000,000 .00	2,970,000 .00
20191225 00000108	002131	利欧股份	2019 年 12 月 25	2020 年 1 月 8 日	2.97	100,000.0 0	297,000.0 0

			日				
20191225 00000105	002131	利欧股份	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	2.97	100,000.0 0	297,000.0 0
20191225 00000109	002131	利欧股份	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	2.97	150,000.0 0	445,500.0 0
20191225 00000110	002131	利欧股份	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	2.97	1,000,000 .00	2,970,000 .00
20191205 00000142	002152	广电运通	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	9.61	220,000.0 0	2,114,200 .00
20191206 00000102	002152	广电运通	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	9.61	300,000.0 0	2,883,000 .00
20191206 00000106	002152	广电运通	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	9.61	240,000.0 0	2,306,400 .00
20191218 00000177	002152	广电运通	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	9.61	11,300.00	108,593.0 0
20191218 00000169	002152	广电运通	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.61	61,800.00	593,898.0 0
20191225 00000106	002152	广电运通	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	9.61	100,000.0 0	961,000.0 0
20191226 00000090	002152	广电运通	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	9.61	36,200.00	347,882.0 0
20191212 00000083	002155	湖南黄金	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	7.89	67,200.00	530,208.0 0
20191218 00000170	002155	湖南黄金	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	7.89	13,100.00	103,359.0 0
20191219 00000149	002155	湖南黄金	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	7.89	45,100.00	355,839.0 0
20191223 00000160	002155	湖南黄金	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.89	53,000.00	418,170.0 0
20191212 00000078	002174	游族网络	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	23.27	29,100.00	677,157.0 0
20191217	002174	游族网络	2019 年	2020 年 1	23.27	55,000.00	1,279,850

00000133			12月17日	月14日			.00
20191217 00000134	002174	游族网络	2019年 12月17日	2020年1 月14日	23.27	25,000.00	581,750.0 0
20191219 00000153	002174	游族网络	2019年 12月19日	2020年1 月2日	23.27	40,000.00	930,800.0 0
20191219 00000152	002174	游族网络	2019年 12月19日	2020年1 月16日	23.27	140,000.0 0	3,257,800 .00
20191219 00000154	002174	游族网络	2019年 12月19日	2020年1 月16日	23.27	88,000.00	2,047,760 .00
20191220 00000062	002174	游族网络	2019年 12月20日	2020年1 月3日	23.27	50,000.00	1,163,500 .00
20191220 00000074	002174	游族网络	2019年 12月20日	2020年1 月17日	23.27	50,000.00	1,163,500 .00
20191220 00000092	002174	游族网络	2019年 12月20日	2020年1 月17日	23.27	50,000.00	1,163,500 .00
20191220 00000096	002174	游族网络	2019年 12月20日	2020年1 月17日	23.27	80,000.00	1,861,600 .00
20191205 00000144	002176	江特电机	2019年 12月5日	2020年1 月2日	3.76	600,000.0 0	2,256,000 .00
20191211 00000213	002176	江特电机	2019年 12月11日	2020年1 月8日	3.76	460,000.0 0	1,729,600 .00
20191212 00000077	002176	江特电机	2019年 12月12日	2020年1 月9日	3.76	65,000.00	244,400.0 0
20191213 00000044	002176	江特电机	2019年 12月13日	2020年1 月10日	3.76	317,400.0 0	1,193,424 .00
20191213 00000051	002176	江特电机	2019年 12月13日	2020年1 月10日	3.76	306,200.0 0	1,151,312 .00
20191218 00000174	002176	江特电机	2019年 12月18日	2020年1 月2日	3.76	89,200.00	335,392.0 0
20191218	002176	江特电机	2019年	2020年1	3.76	66,900.00	251,544.0

00000179			12 月 18 日	月 15 日			0
20191219 00000160	002176	江特电机	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	3.76	384,000.0 0	1,443,840 .00
20191224 00000159	002176	江特电机	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 7 日	3.76	10,000.00	37,600.00
20191224 00000127	002176	江特电机	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	3.76	50,000.00	188,000.0 0
20191224 00000130	002176	江特电机	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	3.76	200,000.0 0	752,000.0 0
20191217 00000135	002180	纳思达	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	32.92	24,300.00	799,956.0 0
20191218 00000178	002183	怡亚通	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.21	82,800.00	348,588.0 0
20191219 00000155	002191	劲嘉股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	11.41	47,500.00	541,975.0 0
20191218 00000180	002195	二三四五	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.23	252,000.0 0	813,960.0 0
20191227 00000191	002195	二三四五	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	3.23	17,000.00	54,910.00
20191217 00000138	002203	海亮股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.25	33,400.00	342,350.0 0
20191211 00000217	002212	南洋股份	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	19.01	60,000.00	1,140,600 .00
20191213 00000062	002212	南洋股份	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	19.01	57,000.00	1,083,570 .00
20191217 00000139	002212	南洋股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.01	30,000.00	570,300.0 0
20191217 00000140	002212	南洋股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.01	28,400.00	539,884.0 0

20191218 00000181	002212	南洋股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	19.01	99,000.00	1,881,990 .00
20191220 00000090	002212	南洋股份	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	19.01	14,500.00	275,645.0 0
20191218 00000183	002217	合 力 泰	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.55	95,500.00	530,025.0 0
20191218 00000182	002221	东华能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.76	64,500.00	500,520.0 0
20191217 00000141	002223	鱼跃医疗	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.32	32,600.00	662,432.0 0
20191217 00000147	002233	塔牌集团	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	12.60	37,400.00	471,240.0 0
20191223 00000165	002233	塔牌集团	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 6 日	12.60	60,000.00	756,000.0 0
20191219 00000162	002242	九阳股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.16	15,600.00	392,496.0 0
20191218 00000192	002244	滨江集团	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.92	63,100.00	310,452.0 0
20191219 00000165	002244	滨江集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	4.92	16,000.00	78,720.00
20191210 00000344	002249	大洋电机	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	3.86	200,000.0 0	772,000.0 0
20191218 00000187	002249	大洋电机	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	3.86	25,900.00	99,974.00
20191218 00000188	002249	大洋电机	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.86	74,900.00	289,114.0 0
20191220 00000077	002249	大洋电机	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	3.86	30,000.00	115,800.0 0
20191217 00000151	002250	联化科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	17.13	36,500.00	625,245.0 0

			日				
20191218 00000190	002266	浙富控股	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.12	87,800.00	361,736.0 0
20191212 00000086	002268	卫士通	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	25.79	31,000.00	799,490.0 0
20191217 00000144	002268	卫士通	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.79	30,300.00	781,437.0 0
20191205 00000162	002273	水晶光电	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	16.16	100,000.0 0	1,616,000 .00
20191206 00000112	002273	水晶光电	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	16.16	320,000.0 0	5,171,200 .00
20191209 00000240	002273	水晶光电	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	16.16	550,000.0 0	8,888,000 .00
20191210 00000350	002273	水晶光电	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	16.16	80,000.00	1,292,800 .00
20191210 00000355	002273	水晶光电	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	16.16	270,000.0 0	4,363,200 .00
20191210 00000368	002273	水晶光电	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	16.16	70,000.00	1,131,200 .00
20191212 00000087	002273	水晶光电	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	16.16	130,000.0 0	2,100,800 .00
20191212 00000088	002273	水晶光电	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	16.16	40,000.00	646,400.0 0
20191212 00000091	002273	水晶光电	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	16.16	40,000.00	646,400.0 0
20191217 00000146	002273	水晶光电	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	16.16	50,000.00	808,000.0 0
20191224 00000160	002273	水晶光电	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	16.16	540,000.0 0	8,726,400 .00
20191205 00000154	002280	联络互动	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	3.87	400,000.0 0	1,548,000 .00
20191205 00000155	002280	联络互动	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	3.87	400,000.0 0	1,548,000 .00

20191205 00000156	002280	联络互动	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	3.87	480,000.0 0	1,857,600 .00
20191205 00000160	002280	联络互动	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	3.87	100,000.0 0	387,000.0 0
20191206 00000114	002280	联络互动	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	3.87	600,000.0 0	2,322,000 .00
20191206 00000117	002280	联络互动	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	3.87	460,000.0 0	1,780,200 .00
20191217 00000148	002280	联络互动	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	3.87	50,000.00	193,500.0 0
20191220 00000076	002280	联络互动	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	3.87	40,000.00	154,800.0 0
20191220 00000073	002280	联络互动	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	3.87	50,000.00	193,500.0 0
20191220 00000075	002280	联络互动	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	3.87	50,000.00	193,500.0 0
20191220 00000093	002280	联络互动	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	3.87	50,000.00	193,500.0 0
20191205 00000169	002281	光迅科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	29.78	35,000.00	1,042,300 .00
20191217 00000150	002281	光迅科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	29.78	21,300.00	634,314.0 0
20191217 00000154	002285	世联行	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	3.75	486,300.0 0	1,823,625 .00
20191218 00000200	002285	世联行	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	3.75	300,000.0 0	1,125,000 .00
20191218 00000201	002285	世联行	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.75	81,900.00	307,125.0 0
20191218 00000202	002285	世联行	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.75	68,000.00	255,000.0 0
20191219 00000159	002285	世联行	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	3.75	400,000.0 0	1,500,000 .00
20191220	002285	世联行	2019 年	2020 年 1	3.75	84,500.00	316,875.0

00000091			12月20日	月17日			0
20191224 00000158	002285	世联行	2019年 12月24日	2020年1 月21日	3.75	200,000.0 0	750,000.0 0
20191204 00000154	002302	西部建设	2019年 12月4日	2020年1 月2日	11.29	780,000.0 0	8,806,200 .00
20191204 00000156	002302	西部建设	2019年 12月4日	2020年1 月2日	11.29	120,000.0 0	1,354,800 .00
20191217 00000153	002302	西部建设	2019年 12月17日	2020年1 月14日	11.29	70,000.00	790,300.0 0
20191217 00000158	002317	众生药业	2019年 12月17日	2020年1 月14日	12.70	35,900.00	455,930.0 0
20191227 00000220	002317	众生药业	2019年 12月27日	2020年1 月10日	12.70	13,000.00	165,100.0 0
20191212 00000092	002340	格林美	2019年 12月12日	2020年1 月9日	4.87	240,000.0 0	1,168,800 .00
20191218 00000207	002340	格林美	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.87	214,400.0 0	1,044,128 .00
20191225 00000115	002340	格林美	2019年 12月25日	2020年1 月22日	4.87	200,000.0 0	974,000.0 0
20191226 00000096	002340	格林美	2019年 12月26日	2020年1 月9日	4.87	100,000.0 0	487,000.0 0
20191226 00000097	002340	格林美	2019年 12月26日	2020年1 月9日	4.87	150,000.0 0	730,500.0 0
20191217 00000155	002353	杰瑞股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	36.96	25,700.00	949,872.0 0
20191219 00000170	002353	杰瑞股份	2019年 12月19日	2020年1 月16日	36.96	90,000.00	3,326,400 .00
20191217 00000163	002358	森源电气	2019年 12月17日	2020年1 月14日	6.99	80,000.00	559,200.0 0
20191206 00000121	002366	台海核电	2019年 12月6日	2020年1 月3日	6.96	150,000.0 0	1,044,000 .00

20191211 00000224	002366	台海核电	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	6.96	280,000.0 0	1,948,800 .00
20191212 00000089	002366	台海核电	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	6.96	96,300.00	670,248.0 0
20191213 00000065	002366	台海核电	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	6.96	30,000.00	208,800.0 0
20191217 00000164	002366	台海核电	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.96	27,600.00	192,096.0 0
20191217 00000160	002366	台海核电	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.96	137,000.0 0	953,520.0 0
20191211 00000231	002368	太极股份	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	38.92	10,000.00	389,200.0 0
20191217 00000159	002368	太极股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	38.92	12,200.00	474,824.0 0
20191205 00000172	002371	北方华创	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	88.00	58,000.00	5,104,000 .00
20191205 00000173	002371	北方华创	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	88.00	40,000.00	3,520,000 .00
20191209 00000246	002371	北方华创	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	88.00	10,000.00	880,000.0 0
20191212 00000094	002371	北方华创	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	88.00	40,000.00	3,520,000 .00
20191213 00000053	002371	北方华创	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	88.00	10,000.00	880,000.0 0
20191213 00000055	002371	北方华创	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	88.00	20,000.00	1,760,000 .00
20191217 00000161	002371	北方华创	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	88.00	11,000.00	968,000.0 0
20191219 00000171	002371	北方华创	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	88.00	40,000.00	3,520,000 .00
20191217 00000162	002372	伟星新材	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.17	35,100.00	462,267.0 0

			日				
20191217 00000165	002373	千方科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	18.04	39,700.00	716,188.0 0
20191219 00000173	002375	亚厦股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.80	45,500.00	263,900.0 0
20191217 00000167	002382	蓝帆医疗	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	12.14	20,000.00	242,800.0 0
20191219 00000174	002382	蓝帆医疗	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	12.14	240,000.0 0	2,913,600 .00
20191212 00000090	002384	东山精密	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	23.15	24,100.00	557,915.0 0
20191218 00000204	002384	东山精密	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	23.15	54,400.00	1,259,360 .00
20191211 00000227	002385	大北农	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	4.98	40,000.00	199,200.0 0
20191213 00000078	002385	大北农	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	4.98	246,900.0 0	1,229,562 .00
20191218 00000203	002385	大北农	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.98	151,400.0 0	753,972.0 0
20191212 00000097	002387	维信诺	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.90	45,000.00	715,500.0 0
20191219 00000189	002387	维信诺	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	15.90	10,000.00	159,000.0 0
20191219 00000188	002387	维信诺	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	15.90	45,700.00	726,630.0 0
20191223 00000183	002387	维信诺	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	15.90	65,000.00	1,033,500 .00
20191225 00000123	002387	维信诺	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	15.90	10,000.00	159,000.0 0
20191212	002390	信邦制药	2019 年	2020 年 1	5.25	64,000.00	336,000.0

00000093			12月12日	月9日			0
20191218 00000205	002390	信邦制药	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.25	65,100.00	341,775.0 0
20191220 00000080	002390	信邦制药	2019年 12月20日	2020年1 月3日	5.25	18,200.00	95,550.00
20191220 00000083	002390	信邦制药	2019年 12月20日	2020年1 月17日	5.25	40,000.00	210,000.0 0
20191219 00000177	002399	海普瑞	2019年 12月19日	2020年1 月16日	19.51	19,500.00	380,445.0 0
20191226 00000106	002399	海普瑞	2019年 12月26日	2020年1 月9日	19.51	17,600.00	343,376.0 0
20191211 00000230	002407	多氟多	2019年 12月11日	2020年1 月8日	13.11	90,000.00	1,179,900 .00
20191217 00000177	002407	多氟多	2019年 12月17日	2020年1 月14日	13.11	38,300.00	502,113.0 0
20191219 00000178	002407	多氟多	2019年 12月19日	2020年1 月2日	13.11	12,000.00	157,320.0 0
20191219 00000182	002407	多氟多	2019年 12月19日	2020年1 月16日	13.11	100,000.0 0	1,311,000 .00
20191224 00000156	002407	多氟多	2019年 12月24日	2020年1 月21日	13.11	100,000.0 0	1,311,000 .00
20191227 00000230	002407	多氟多	2019年 12月27日	2020年2 月3日	13.11	100,000.0 0	1,311,000 .00
20191227 00000234	002407	多氟多	2019年 12月27日	2020年2 月3日	13.11	100,000.0 0	1,311,000 .00
20191227 00000237	002407	多氟多	2019年 12月27日	2020年2 月3日	13.11	300,000.0 0	3,933,000 .00
20191218 00000210	002408	齐翔腾达	2019年 12月18日	2020年1 月2日	7.15	13,700.00	97,955.00

20191219 00000176	002408	齐翔腾达	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	7.15	50,100.00	358,215.0 0
20191227 00000232	002408	齐翔腾达	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	7.15	47,500.00	339,625.0 0
20191219 00000183	002414	高德红外	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	21.00	19,800.00	415,800.0 0
20191224 00000148	002414	高德红外	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	21.00	10,000.00	210,000.0 0
20191206 00000130	002416	爱施德	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	7.61	220,000.0 0	1,674,200 .00
20191223 00000186	002416	爱施德	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.61	40,000.00	304,400.0 0
20191223 00000187	002416	爱施德	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.61	40,000.00	304,400.0 0
20191223 00000188	002416	爱施德	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.61	130,000.0 0	989,300.0 0
20191223 00000194	002416	爱施德	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.61	140,000.0 0	1,065,400 .00
20191223 00000202	002416	爱施德	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.61	20,000.00	152,200.0 0
20191217 00000171	002419	天虹股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.55	24,800.00	261,640.0 0
20191219 00000185	002419	天虹股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.55	27,700.00	292,235.0 0
20191219 00000179	002424	贵州百灵	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	8.71	22,900.00	199,459.0 0
20191205 00000184	002426	胜利精密	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	2.36	582,000.0 0	1,373,520 .00
20191212 00000102	002426	胜利精密	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	2.36	346,400.0 0	817,504.0 0
20191218	002426	胜利精密	2019 年	2020 年 1	2.36	121,900.0	287,684.0

00000213			12 月 18 日	月 2 日		0	0
20191218 00000214	002426	胜利精密	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.36	130,800.0 0	308,688.0 0
20191219 00000186	002426	胜利精密	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	2.36	62,000.00	146,320.0 0
20191220 00000084	002426	胜利精密	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	2.36	150,000.0 0	354,000.0 0
20191223 00000189	002426	胜利精密	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	2.36	171,000.0 0	403,560.0 0
20191225 00000121	002426	胜利精密	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	2.36	500,000.0 0	1,180,000 .00
20191227 00000236	002426	胜利精密	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	2.36	150,000.0 0	354,000.0 0
20191227 00000240	002426	胜利精密	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	2.36	61,000.00	143,960.0 0
20191227 00000235	002426	胜利精密	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	2.36	162,000.0 0	382,320.0 0
20191217 00000173	002434	万里扬	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	9.48	29,200.00	276,816.0 0
20191227 00000239	002434	万里扬	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	9.48	10,000.00	94,800.00
20191212 00000095	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	3.03	64,000.00	193,920.0 0
20191212 00000103	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	3.03	340,000.0 0	1,030,200 .00
20191218 00000216	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	3.03	50,500.00	153,015.0 0
20191218 00000215	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.03	64,000.00	193,920.0 0

20191219 00000187	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	3.03	50,000.00	151,500.0 0
20191223 00000191	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	3.03	133,000.0 0	402,990.0 0
20191224 00000164	002437	誉衡药业	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	3.03	250,000.0 0	757,500.0 0
20191217 00000172	002439	启明星辰	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	33.80	32,000.00	1,081,600 .00
20191217 00000179	002440	闰土股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	11.20	38,800.00	434,560.0 0
20191217 00000176	002444	巨星科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.74	27,700.00	297,498.0 0
20191218 00000229	002465	海格通信	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.83	100,300.0 0	1,086,249 .00
20191218 00000241	002470	金正大	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.66	91,900.00	244,454.0 0
20191225 00000132	002470	金正大	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	2.66	377,000.0 0	1,002,820 .00
20191219 00000192	002482	广田集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	4.38	42,900.00	187,902.0 0
20191213 00000071	002491	通鼎互联	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	6.61	149,700.0 0	989,517.0 0
20191219 00000193	002491	通鼎互联	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	6.61	51,200.00	338,432.0 0
20191218 00000231	002500	山西证券	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.29	90,300.00	748,587.0 0
20191218 00000244	002503	搜于特	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.39	85,400.00	204,106.0 0
20191227 00000262	002503	搜于特	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	2.39	550,000.0 0	1,314,500 .00

			日				
20191227 00000255	002503	搜于特	2019年 12月27 日	2020年2 月3日	2.39	400,000.0 0	956,000.0 0
20191227 00000257	002503	搜于特	2019年 12月27 日	2020年2 月3日	2.39	1,000,000 .00	2,390,000 .00
20191227 00000258	002503	搜于特	2019年 12月27 日	2020年2 月3日	2.39	200,000.0 0	478,000.0 0
20191205 00000199	002505	大康农业	2019年 12月5日	2020年1 月2日	1.75	1,000,000 .00	1,750,000 .00
20191205 00000201	002505	大康农业	2019年 12月5日	2020年1 月2日	1.75	1,000,000 .00	1,750,000 .00
20191209 00000267	002505	大康农业	2019年 12月9日	2020年1 月6日	1.75	1,000,000 .00	1,750,000 .00
20191209 00000268	002505	大康农业	2019年 12月9日	2020年1 月6日	1.75	500,000.0 0	875,000.0 0
20191210 00000408	002505	大康农业	2019年 12月10 日	2020年1 月7日	1.75	1,000,000 .00	1,750,000 .00
20191210 00000410	002505	大康农业	2019年 12月10 日	2020年1 月7日	1.75	300,000.0 0	525,000.0 0
20191212 00000096	002505	大康农业	2019年 12月12 日	2020年1 月9日	1.75	320,000.0 0	560,000.0 0
20191217 00000182	002505	大康农业	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	1.75	380,000.0 0	665,000.0 0
20191220 00000098	002505	大康农业	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	1.75	320,000.0 0	560,000.0 0
20191224 00000178	002505	大康农业	2019年 12月24 日	2020年1 月21日	1.75	70,000.00	122,500.0 0
20191210 00000411	002507	涪陵榨菜	2019年 12月10 日	2020年1 月7日	26.73	20,000.00	534,600.0 0
20191217 00000184	002507	涪陵榨菜	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	26.73	27,500.00	735,075.0 0
20191219 00000196	002544	杰赛科技	2019年 12月19	2020年1 月16日	13.62	17,400.00	236,988.0 0

			日				
20191217 00000188	002572	索 菲 亚	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.95	35,600.00	745,820.0 0
20191220 00000095	002572	索 菲 亚	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	20.95	40,000.00	838,000.0 0
20191225 00000137	002572	索 菲 亚	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	20.95	10,000.00	209,500.0 0
20191217 00000189	002573	清新环境	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.45	35,200.00	227,040.0 0
20191213 00000080	002583	海 能 达	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	8.41	13,700.00	115,217.0 0
20191219 00000199	002583	海 能 达	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	8.41	52,100.00	438,161.0 0
20191220 00000102	002583	海 能 达	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	8.41	10,700.00	89,987.00
20191218 00000238	002589	瑞康医药	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	7.69	13,200.00	101,508.0 0
20191218 00000236	002589	瑞康医药	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.69	66,000.00	507,540.0 0
20191218 00000237	002589	瑞康医药	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.69	70,000.00	538,300.0 0
20191226 00000118	002589	瑞康医药	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	7.69	10,000.00	76,900.00
20191226 00000119	002589	瑞康医药	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	7.69	19,000.00	146,110.0 0
20191212 00000101	002603	以岭药业	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	12.43	20,000.00	248,600.0 0
20191217 00000190	002603	以岭药业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	12.43	27,300.00	339,339.0 0
20191226	002603	以岭药业	2019 年	2020 年 1	12.43	10,000.00	124,300.0

00000135			12月26日	月9日			0
20191211 00000261	002635	安洁科技	2019年 12月11日	2020年1 月8日	16.67	130,000.0 0	2,167,100 .00
20191212 00000104	002635	安洁科技	2019年 12月12日	2020年1 月9日	16.67	17,000.00	283,390.0 0
20191212 00000105	002635	安洁科技	2019年 12月12日	2020年1 月9日	16.67	59,000.00	983,530.0 0
20191213 00000077	002635	安洁科技	2019年 12月13日	2020年1 月10日	16.67	58,100.00	968,527.0 0
20191213 00000081	002635	安洁科技	2019年 12月13日	2020年1 月10日	16.67	288,000.0 0	4,800,960 .00
20191217 00000194	002635	安洁科技	2019年 12月17日	2020年1 月14日	16.67	110,000.0 0	1,833,700 .00
20191226 00000123	002635	安洁科技	2019年 12月26日	2020年1 月9日	16.67	29,600.00	493,432.0 0
20191204 00000168	002640	跨境通	2019年 12月4日	2020年1 月2日	7.72	450,000.0 0	3,474,000 .00
20191219 00000198	002640	跨境通	2019年 12月19日	2020年1 月16日	7.72	43,100.00	332,732.0 0
20191223 00000197	002640	跨境通	2019年 12月23日	2020年1 月20日	7.72	55,000.00	424,600.0 0
20191226 00000122	002640	跨境通	2019年 12月26日	2020年1 月9日	7.72	10,000.00	77,200.00
20191219 00000201	002653	海思科	2019年 12月19日	2020年1 月16日	20.36	10,000.00	203,600.0 0
20191223 00000203	002653	海思科	2019年 12月23日	2020年1 月20日	20.36	47,000.00	956,920.0 0
20191213 00000079	002665	首航高科	2019年 12月13日	2020年1 月10日	3.36	298,500.0 0	1,002,960 .00
20191218	002665	首航高科	2019年	2020年1	3.36	116,000.0	389,760.0

00000252			12 月 18 日	月 15 日		0	0
20191220 00000106	002665	首航高科	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	3.36	40,000.00	134,400.0 0
20191227 00000270	002665	首航高科	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	3.36	115,000.0 0	386,400.0 0
20191205 00000202	002670	国盛金控	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	12.71	190,000.0 0	2,414,900 .00
20191211 00000258	002670	国盛金控	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	12.71	180,000.0 0	2,287,800 .00
20191212 00000106	002670	国盛金控	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	12.71	35,000.00	444,850.0 0
20191213 00000084	002670	国盛金控	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	12.71	118,900.0 0	1,511,219 .00
20191213 00000085	002670	国盛金控	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	12.71	10,900.00	138,539.0 0
20191218 00000249	002670	国盛金控	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	12.71	161,800.0 0	2,056,478 .00
20191218 00000255	002670	国盛金控	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	12.71	50,000.00	635,500.0 0
20191218 00000256	002670	国盛金控	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	12.71	20,000.00	254,200.0 0
20191218 00000245	002670	国盛金控	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	12.71	175,000.0 0	2,224,250 .00
20191218 00000246	002670	国盛金控	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	12.71	51,800.00	658,378.0 0
20191218 00000251	002670	国盛金控	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	12.71	125,000.0 0	1,588,750 .00
20191219 00000200	002670	国盛金控	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	12.71	12,000.00	152,520.0 0
20191220	002670	国盛金控	2019 年	2020 年 1	12.71	50,000.00	635,500.0

00000109			12月20日	月3日			0
20191223 00000210	002670	国盛金控	2019年 12月23日	2020年1 月20日	12.71	81,000.00	1,029,510 .00
20191226 00000124	002670	国盛金控	2019年 12月26日	2020年1 月9日	12.71	50,000.00	635,500.0 0
20191212 00000107	002672	东江环保	2019年 12月12日	2020年1 月9日	9.00	34,800.00	313,200.0 0
20191217 00000196	002672	东江环保	2019年 12月17日	2020年1 月14日	9.00	23,700.00	213,300.0 0
20191218 00000260	002681	奋达科技	2019年 12月18日	2020年1 月2日	5.58	262,900.0 0	1,466,982 .00
20191218 00000253	002681	奋达科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.58	46,300.00	258,354.0 0
20191218 00000257	002681	奋达科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.58	140,000.0 0	781,200.0 0
20191218 00000258	002681	奋达科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.58	140,000.0 0	781,200.0 0
20191218 00000259	002681	奋达科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.58	140,000.0 0	781,200.0 0
20191219 00000204	002690	美亚光电	2019年 12月19日	2020年1 月16日	39.10	13,500.00	527,850.0 0
20191219 00000195	002690	美亚光电	2019年 12月19日	2020年1 月16日	39.10	80,000.00	3,128,000 .00
20191218 00000266	002701	奥瑞金	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.41	79,300.00	349,713.0 0
20191226 00000134	002701	奥瑞金	2019年 12月26日	2020年1 月9日	4.41	10,000.00	44,100.00
20191211 00000260	002709	天赐材料	2019年 12月11日	2020年1 月8日	20.70	110,000.0 0	2,277,000 .00

20191217 00000198	002709	天赐材料	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.70	53,200.00	1,101,240 .00
20191218 00000262	002709	天赐材料	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	20.70	10,000.00	207,000.0 0
20191219 00000203	002709	天赐材料	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	20.70	10,000.00	207,000.0 0
20191219 00000202	002709	天赐材料	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	20.70	13,900.00	287,730.0 0
20191220 00000110	002709	天赐材料	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	20.70	15,000.00	310,500.0 0
20191224 00000177	002709	天赐材料	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	20.70	20,000.00	414,000.0 0
20191217 00000209	002745	木林森	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.61	20,200.00	274,922.0 0
20191227 00000284	002745	木林森	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	13.61	30,000.00	408,300.0 0
20191204 00000174	002797	第一创业	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	8.28	300,000.0 0	2,484,000 .00
20191204 00000178	002797	第一创业	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	8.28	160,000.0 0	1,324,800 .00
20191205 00000216	002797	第一创业	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	8.28	239,000.0 0	1,978,920 .00
20191205 00000221	002797	第一创业	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	8.28	240,000.0 0	1,987,200 .00
20191209 00000294	002797	第一创业	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	8.28	160,000.0 0	1,324,800 .00
20191209 00000295	002797	第一创业	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	8.28	400,000.0 0	3,312,000 .00
20191211 00000266	002797	第一创业	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	8.28	50,000.00	414,000.0 0
20191218 00000268	002797	第一创业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	8.28	18,200.00	150,696.0 0
20191218 00000273	002797	第一创业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.28	200,000.0 0	1,656,000 .00

			日				
20191218 00000261	002797	第一创业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.28	101,500.0 0	840,420.0 0
20191220 00000113	002797	第一创业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.28	60,000.00	496,800.0 0
20191220 00000115	002797	第一创业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.28	60,000.00	496,800.0 0
20191220 00000116	002797	第一创业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.28	50,000.00	414,000.0 0
20191220 00000117	002797	第一创业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.28	60,000.00	496,800.0 0
20191220 00000118	002797	第一创业	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.28	60,000.00	496,800.0 0
20191224 00000175	002797	第一创业	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	8.28	60,000.00	496,800.0 0
20191224 00000180	002797	第一创业	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	8.28	50,000.00	414,000.0 0
20191225 00000141	002797	第一创业	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	8.28	30,000.00	248,400.0 0
20191226 00000130	002797	第一创业	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	8.28	190,000.0 0	1,573,200 .00
20191209 00000296	002812	恩捷股份	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	50.50	25,000.00	1,262,500 .00
20191217 00000211	002812	恩捷股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	50.50	20,600.00	1,040,300 .00
20191226 00000129	002812	恩捷股份	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	50.50	19,000.00	959,500.0 0
20191219 00000207	002821	凯莱英	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	129.50	10,000.00	1,295,000 .00
20191219 00000208	002821	凯莱英	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	129.50	30,000.00	3,885,000 .00

			日				
20191219 00000209	002839	张家港行	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.94	49,700.00	295,218.0 0
20191219 00000210	002925	盈趣科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	43.95	10,000.00	439,500.0 0
20191218 00000270	002926	华西证券	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	11.01	70,300.00	774,003.0 0
20191210 00000443	300001	特锐德	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	17.18	40,000.00	687,200.0 0
20191217 00000220	300001	特锐德	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	17.18	29,100.00	499,938.0 0
20191209 00000303	300002	神州泰岳	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	3.26	312,000.0 0	1,017,120 .00
20191218 00000263	300002	神州泰岳	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.26	106,400.0 0	346,864.0 0
20191213 00000088	300009	安科生物	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.09	10,000.00	150,900.0 0
20191217 00000222	300009	安科生物	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.09	35,200.00	531,168.0 0
20191226 00000131	300009	安科生物	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	15.09	10,000.00	150,900.0 0
20191211 00000274	300010	立思辰	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	12.91	10,000.00	129,100.0 0
20191212 00000116	300010	立思辰	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	12.91	45,200.00	583,532.0 0
20191213 00000089	300010	立思辰	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	12.91	340,000.0 0	4,389,400 .00
20191213 00000090	300010	立思辰	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	12.91	178,600.0 0	2,305,726 .00
20191217 00000223	300010	立思辰	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	12.91	29,800.00	384,718.0 0

			日				
20191217 00000224	300010	立思辰	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	12.91	60,000.00	774,600.0 0
20191218 00000279	300010	立思辰	2019年 12月18 日	2020年1 月2日	12.91	100,000.0 0	1,291,000 .00
20191218 00000275	300010	立思辰	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	12.91	80,000.00	1,032,800 .00
20191219 00000219	300010	立思辰	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	12.91	21,700.00	280,147.0 0
20191224 00000186	300010	立思辰	2019年 12月24 日	2020年1 月7日	12.91	50,000.00	645,500.0 0
20191227 00000287	300010	立思辰	2019年 12月27 日	2020年1 月10日	12.91	79,500.00	1,026,345 .00
20191227 00000297	300010	立思辰	2019年 12月27 日	2020年2 月3日	12.91	12,700.00	163,957.0 0
20191218 00000280	300012	华测检测	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	14.91	66,800.00	995,988.0 0
20191217 00000227	300014	亿纬锂能	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	50.16	36,000.00	1,805,760 .00
20191217 00000228	300014	亿纬锂能	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	50.16	68,700.00	3,445,992 .00
20191218 00000292	300014	亿纬锂能	2019年 12月18 日	2020年1 月2日	50.16	12,000.00	601,920.0 0
20191218 00000282	300014	亿纬锂能	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	50.16	22,800.00	1,143,648 .00
20191225 00000142	300014	亿纬锂能	2019年 12月25 日	2020年1 月22日	50.16	27,800.00	1,394,448 .00
20191218 00000288	300026	红日药业	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	3.51	120,200.0 0	421,902.0 0
20191217	300027	华谊兄弟	2019年	2020年1	4.63	214,000.0	990,820.0

00000231			12 月 17 日	月 14 日		0	0
20191218 00000286	300027	华谊兄弟	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.63	101,600.0 0	470,408.0 0
20191220 00000123	300027	华谊兄弟	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	4.63	80,000.00	370,400.0 0
20191223 00000215	300027	华谊兄弟	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	4.63	79,000.00	365,770.0 0
20191224 00000188	300027	华谊兄弟	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	4.63	150,000.0 0	694,500.0 0
20191218 00000295	300058	蓝色光标	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.65	108,700.0 0	614,155.0 0
20191218 00000306	300072	三聚环保	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.32	66,500.00	420,280.0 0
20191219 00000227	300072	三聚环保	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	6.32	300,000.0 0	1,896,000 .00
20191220 00000126	300072	三聚环保	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	6.32	200,000.0 0	1,264,000 .00
20191223 00000216	300072	三聚环保	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	6.32	235,000.0 0	1,485,200 .00
20191226 00000136	300072	三聚环保	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	6.32	122,000.0 0	771,040.0 0
20191204 00000187	300088	长信科技	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	10.27	1,000,000 .00	10,270,00 0.00
20191217 00000238	300088	长信科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.27	80,000.00	821,600.0 0
20191217 00000240	300088	长信科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.27	200,000.0 0	2,054,000 .00
20191218 00000313	300088	长信科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.27	1,000,000 .00	10,270,00 0.00
20191218	300088	长信科技	2019 年	2020 年 1	10.27	430,000.0	4,416,100

00000314			12 月 18 日	月 15 日		0	.00
20191219 00000225	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	10.27	100,000.0 0	1,027,000 .00
20191219 00000223	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	100,000.0 0	1,027,000 .00
20191219 00000226	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	100,000.0 0	1,027,000 .00
20191219 00000229	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	60,000.00	616,200.0 0
20191219 00000230	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	200,000.0 0	2,054,000 .00
20191219 00000231	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	100,000.0 0	1,027,000 .00
20191219 00000232	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	100,000.0 0	1,027,000 .00
20191219 00000234	300088	长信科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.27	100,000.0 0	1,027,000 .00
20191205 00000231	300113	顺网科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	25.69	70,000.00	1,798,300 .00
20191205 00000240	300113	顺网科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	25.69	100,000.0 0	2,569,000 .00
20191206 00000170	300113	顺网科技	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	25.69	30,000.00	770,700.0 0
20191212 00000110	300113	顺网科技	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	25.69	20,000.00	513,800.0 0
20191217 00000243	300113	顺网科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.69	70,000.00	1,798,300 .00
20191217 00000244	300113	顺网科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.69	50,000.00	1,284,500 .00
20191217 00000245	300113	顺网科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.69	22,000.00	565,180.0 0

20191217 00000246	300113	顺网科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.69	40,000.00	1,027,600 .00
20191219 00000235	300113	顺网科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	25.69	110,000.0 0	2,825,900 .00
20191219 00000233	300113	顺网科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.69	120,000.0 0	3,082,800 .00
20191206 00000171	300115	长盈精密	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	17.79	100,000.0 0	1,779,000 .00
20191206 00000172	300115	长盈精密	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	17.79	50,000.00	889,500.0 0
20191206 00000174	300115	长盈精密	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	17.79	186,000.0 0	3,308,940 .00
20191206 00000175	300115	长盈精密	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	17.79	75,000.00	1,334,250 .00
20191209 00000315	300115	长盈精密	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	17.79	30,000.00	533,700.0 0
20191210 00000453	300115	长盈精密	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	17.79	200,000.0 0	3,558,000 .00
20191210 00000458	300115	长盈精密	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	17.79	100,000.0 0	1,779,000 .00
20191211 00000279	300115	长盈精密	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	17.79	200,000.0 0	3,558,000 .00
20191211 00000285	300115	长盈精密	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	17.79	20,000.00	355,800.0 0
20191217 00000249	300115	长盈精密	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	17.79	40,000.00	711,600.0 0
20191211 00000287	300133	华策影视	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	7.40	500,000.0 0	3,700,000 .00
20191218 00000330	300133	华策影视	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.40	50,300.00	372,220.0 0
20191205 00000243	300134	大富科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	15.42	124,000.0 0	1,912,080 .00
20191212 00000115	300134	大富科技	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.42	20,000.00	308,400.0 0

			日				
20191213 00000093	300134	大富科技	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.42	67,700.00	1,043,934 .00
20191213 00000094	300134	大富科技	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.42	80,000.00	1,233,600 .00
20191219 00000242	300134	大富科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	15.42	19,300.00	297,606.0 0
20191223 00000221	300134	大富科技	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	15.42	37,000.00	570,540.0 0
20191226 00000138	300134	大富科技	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	15.42	80,000.00	1,233,600 .00
20191227 00000303	300134	大富科技	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	15.42	22,000.00	339,240.0 0
20191219 00000248	300166	东方国信	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	13.00	42,100.00	547,300.0 0
20191204 00000191	300168	万达信息	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	15.43	200,000.0 0	3,086,000 .00
20191204 00000192	300168	万达信息	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	15.43	200,000.0 0	3,086,000 .00
20191205 00000254	300168	万达信息	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	15.43	500,000.0 0	7,715,000 .00
20191212 00000118	300168	万达信息	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.43	20,000.00	308,600.0 0
20191217 00000252	300168	万达信息	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.43	100,000.0 0	1,543,000 .00
20191217 00000260	300168	万达信息	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.43	60,000.00	925,800.0 0
20191218 00000345	300168	万达信息	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	15.43	17,300.00	266,939.0 0
20191219 00000239	300168	万达信息	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	15.43	10,000.00	154,300.0 0
20191220	300168	万达信息	2019 年	2020 年 1	15.43	100,000.0	1,543,000

00000133			12月20日	月17日		0	.00
20191218 00000344	300180	华峰超纤	2019年 12月18日	2020年1 月2日	8.84	11,100.00	98,124.00
20191218 00000342	300180	华峰超纤	2019年 12月18日	2020年1 月15日	8.84	230,000.0 0	2,033,200 .00
20191219 00000250	300180	华峰超纤	2019年 12月19日	2020年1 月16日	8.84	47,300.00	418,132.0 0
20191218 00000355	300182	捷成股份	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.49	111,400.0 0	388,786.0 0
20191220 00000134	300182	捷成股份	2019年 12月20日	2020年1 月3日	3.49	100,000.0 0	349,000.0 0
20191224 00000201	300182	捷成股份	2019年 12月24日	2020年1 月21日	3.49	120,000.0 0	418,800.0 0
20191218 00000358	300197	铁汉生态	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.06	83,400.00	255,204.0 0
20191206 00000180	300199	翰宇药业	2019年 12月6日	2020年1 月3日	5.80	199,000.0 0	1,154,200 .00
20191212 00000111	300199	翰宇药业	2019年 12月12日	2020年1 月9日	5.80	11,500.00	66,700.00
20191212 00000123	300199	翰宇药业	2019年 12月12日	2020年1 月9日	5.80	25,000.00	145,000.0 0
20191217 00000250	300199	翰宇药业	2019年 12月17日	2020年1 月14日	5.80	26,600.00	154,280.0 0
20191224 00000204	300199	翰宇药业	2019年 12月24日	2020年1 月21日	5.80	100,000.0 0	580,000.0 0
20191226 00000143	300199	翰宇药业	2019年 12月26日	2020年1 月9日	5.80	10,000.00	58,000.00
20191205 00000255	300207	欣旺达	2019年 12月5日	2020年1 月2日	19.52	50,000.00	976,000.0 0
20191206 00000176	300207	欣旺达	2019年 12月6日	2020年1 月3日	19.52	100,000.0 0	1,952,000 .00

20191209 00000330	300207	欣旺达	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	19.52	50,000.00	976,000.0 0
20191209 00000331	300207	欣旺达	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	19.52	60,000.00	1,171,200 .00
20191211 00000292	300207	欣旺达	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	19.52	51,000.00	995,520.0 0
20191212 00000112	300207	欣旺达	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	19.52	50,000.00	976,000.0 0
20191217 00000251	300207	欣旺达	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.52	80,000.00	1,561,600 .00
20191218 00000352	300207	欣旺达	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	19.52	10,000.00	195,200.0 0
20191218 00000351	300207	欣旺达	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	19.52	56,600.00	1,104,832 .00
20191224 00000206	300207	欣旺达	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 7 日	19.52	50,000.00	976,000.0 0
20191225 00000147	300207	欣旺达	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	19.52	20,000.00	390,400.0 0
20191217 00000258	300244	迪安诊断	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	22.13	20,500.00	453,665.0 0
20191220 00000137	300244	迪安诊断	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	22.13	50,000.00	1,106,500 .00
20191225 00000153	300244	迪安诊断	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	22.13	10,000.00	221,300.0 0
20191226 00000142	300244	迪安诊断	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	22.13	10,000.00	221,300.0 0
20191217 00000262	300251	光线传媒	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	11.80	50,000.00	590,000.0 0
20191219 00000245	300251	光线传媒	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	11.80	42,800.00	505,040.0 0
20191223	300251	光线传媒	2019 年	2020 年 1	11.80	100,000.0	1,180,000

00000229			12 月 23 日	月 20 日		0	.00
20191218 00000363	300253	卫宁健康	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	14.98	72,800.00	1,090,544 .00
20191219 00000249	300257	开山股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	10.88	17,300.00	188,224.0 0
20191223 00000235	300257	开山股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	10.88	280,000.0 0	3,046,400 .00
20191212 00000124	300274	阳光电源	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	10.53	44,500.00	468,585.0 0
20191218 00000361	300274	阳光电源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.53	52,500.00	552,825.0 0
20191217 00000264	300285	国瓷材料	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	22.85	34,300.00	783,755.0 0
20191223 00000239	300285	国瓷材料	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	22.85	110,900.0 0	2,534,065 .00
20191218 00000364	300296	利亚德	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.67	93,400.00	716,378.0 0
20191226 00000145	300296	利亚德	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	7.67	233,000.0 0	1,787,110 .00
20191226 00000140	300296	利亚德	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	7.67	1,000,000 .00	7,670,000 .00
20191227 00000314	300296	利亚德	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	7.67	30,000.00	230,100.0 0
20191205 00000261	300297	蓝盾股份	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	5.64	190,000.0 0	1,071,600 .00
20191212 00000127	300297	蓝盾股份	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	5.64	40,000.00	225,600.0 0
20191217 00000261	300297	蓝盾股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	5.64	38,800.00	218,832.0 0
20191218	300297	蓝盾股份	2019 年	2020 年 1	5.64	16,900.00	95,316.00

00000368			12月18日	月2日			
20191226 00000144	300297	蓝盾股份	2019年 12月26日	2020年1 月9日	5.64	36,100.00	203,604.0 0
20191217 00000263	300308	中际旭创	2019年 12月17日	2020年1 月14日	52.15	10,700.00	558,005.0 0
20191226 00000152	300308	中际旭创	2019年 12月26日	2020年1 月9日	52.15	10,000.00	521,500.0 0
20191209 00000340	300315	掌趣科技	2019年 12月9日	2020年1 月6日	6.17	700,000.0 0	4,319,000 .00
20191209 00000345	300315	掌趣科技	2019年 12月9日	2020年1 月6日	6.17	220,000.0 0	1,357,400 .00
20191210 00000487	300315	掌趣科技	2019年 12月10日	2020年1 月7日	6.17	230,000.0 0	1,419,100 .00
20191217 00000267	300315	掌趣科技	2019年 12月17日	2020年1 月14日	6.17	170,000.0 0	1,048,900 .00
20191217 00000268	300315	掌趣科技	2019年 12月17日	2020年1 月14日	6.17	150,000.0 0	925,500.0 0
20191217 00000269	300315	掌趣科技	2019年 12月17日	2020年1 月14日	6.17	119,200.0 0	735,464.0 0
20191217 00000272	300315	掌趣科技	2019年 12月17日	2020年1 月14日	6.17	163,000.0 0	1,005,710 .00
20191218 00000376	300315	掌趣科技	2019年 12月18日	2020年1 月15日	6.17	11,400.00	70,338.00
20191219 00000260	300315	掌趣科技	2019年 12月19日	2020年1 月16日	6.17	100,000.0 0	617,000.0 0
20191220 00000140	300315	掌趣科技	2019年 12月20日	2020年1 月3日	6.17	50,000.00	308,500.0 0
20191220 00000139	300315	掌趣科技	2019年 12月20日	2020年1 月17日	6.17	50,000.00	308,500.0 0
20191220 00000142	300315	掌趣科技	2019年 12月20日	2020年1 月17日	6.17	500,000.0 0	3,085,000 .00

			日				
20191220 00000144	300315	掌趣科技	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	6.17	730,000.0 0	4,504,100 .00
20191217 00000265	300316	晶盛机电	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.72	33,200.00	521,904.0 0
20191225 00000154	300316	晶盛机电	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	15.72	50,000.00	786,000.0 0
20191226 00000151	300316	晶盛机电	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	15.72	30,000.00	471,600.0 0
20191226 00000155	300316	晶盛机电	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	15.72	20,000.00	314,400.0 0
20191227 00000322	300316	晶盛机电	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	15.72	20,000.00	314,400.0 0
20191218 00000382	300324	旋极信息	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.60	55,500.00	310,800.0 0
20191220 00000145	300324	旋极信息	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	5.60	40,000.00	224,000.0 0
20191218 00000391	300383	光环新网	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	20.07	56,500.00	1,133,955 .00
20191209 00000337	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	16.75	140,000.0 0	2,345,000 .00
20191211 00000305	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	16.75	20,000.00	335,000.0 0
20191212 00000125	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	16.75	33,600.00	562,800.0 0
20191213 00000097	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	16.75	65,000.00	1,088,750 .00
20191217 00000274	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	16.75	36,200.00	606,350.0 0
20191223 00000246	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	16.75	25,000.00	418,750.0 0

			日				
20191225 00000158	300418	昆仑万维	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	16.75	100,000.0 0	1,675,000 .00
20191217 00000275	300529	健帆生物	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	71.84	11,200.00	804,608.0 0
20191223 00000247	300529	健帆生物	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	71.84	100,900.0 0	7,248,656 .00
20191212 00000163	600006	东风汽车	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	4.58	20,000.00	91,600.00
20191218 00000661	600006	东风汽车	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	4.58	21,600.00	98,928.00
20191219 00000393	600006	东风汽车	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	4.58	32,000.00	146,560.0 0
20191219 00000367	600006	东风汽车	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	4.58	42,300.00	193,734.0 0
20191218 00000654	600008	首创股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	3.29	30,100.00	99,029.00
20191218 00000645	600008	首创股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.29	125,400.0 0	412,566.0 0
20191218 00000592	600017	日照港	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.91	101,300.0 0	294,783.0 0
20191218 00000545	600021	上海电力	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.05	70,100.00	564,305.0 0
20191218 00000630	600022	山东钢铁	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	1.43	359,300.0 0	513,799.0 0
20191220 00000199	600022	山东钢铁	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	1.43	60,000.00	85,800.00
20191218 00000633	600026	中远海能	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	6.38	16,200.00	103,356.0 0
20191218	600026	中远海能	2019 年	2020 年 1	6.38	71,800.00	458,084.0

00000484			12 月 18 日	月 15 日			0
20191223 00000283	600026	中远海能	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	6.38	161,000.0 0	1,027,180 .00
20191225 00000180	600026	中远海能	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	6.38	322,000.0 0	2,054,360 .00
20191218 00000662	600037	歌华有线	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.01	52,600.00	473,926.0 0
20191227 00000537	600037	歌华有线	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	9.01	37,000.00	333,370.0 0
20191213 00000146	600039	四川路桥	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	3.36	406,200.0 0	1,364,832 .00
20191218 00000659	600039	四川路桥	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.36	120,600.0 0	405,216.0 0
20191204 00000264	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	25.43	110,000.0 0	2,797,300 .00
20191218 00000555	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	25.43	14,000.00	356,020.0 0
20191219 00000371	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.43	10,000.00	254,300.0 0
20191220 00000191	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	25.43	14,100.00	358,563.0 0
20191224 00000270	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	25.43	10,000.00	254,300.0 0
20191224 00000272	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	25.43	50,000.00	1,271,500 .00
20191224 00000274	600053	九鼎投资	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	25.43	28,000.00	712,040.0 0
20191217 00000327	600056	中国医药	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.05	29,300.00	382,365.0 0
20191219	600058	五矿发展	2019 年	2020 年 1	8.02	22,800.00	182,856.0

00000285			12月19日	月16日			0
20191213 00000145	600060	海信视像	2019年 12月13日	2020年1 月10日	10.85	12,800.00	138,880.0 0
20191219 00000361	600060	海信视像	2019年 12月19日	2020年1 月16日	10.85	45,000.00	488,250.0 0
20191226 00000212	600060	海信视像	2019年 12月26日	2020年1 月23日	10.85	70,700.00	767,095.0 0
20191212 00000171	600062	华润双鹤	2019年 12月12日	2020年1 月9日	13.05	24,200.00	315,810.0 0
20191217 00000420	600062	华润双鹤	2019年 12月17日	2020年1 月14日	13.05	28,900.00	377,145.0 0
20191223 00000367	600062	华润双鹤	2019年 12月23日	2020年1 月20日	13.05	240,000.0 0	3,132,000 .00
20191219 00000425	600064	南京高科	2019年 12月19日	2020年1 月16日	9.75	56,700.00	552,825.0 0
20191217 00000303	600073	上海梅林	2019年 12月17日	2020年1 月14日	7.97	36,800.00	293,296.0 0
20191219 00000307	600079	人福医药	2019年 12月19日	2020年1 月16日	13.51	53,800.00	726,838.0 0
20191206 00000240	600094	大名城	2019年 12月6日	2020年1 月3日	5.85	500,000.0 0	2,925,000 .00
20191209 00000396	600094	大名城	2019年 12月9日	2020年1 月6日	5.85	320,000.0 0	1,872,000 .00
20191217 00000352	600094	大名城	2019年 12月17日	2020年1 月14日	5.85	80,000.00	468,000.0 0
20191217 00000354	600094	大名城	2019年 12月17日	2020年1 月14日	5.85	250,000.0 0	1,462,500 .00
20191217 00000356	600094	大名城	2019年 12月17日	2020年1 月14日	5.85	100,000.0 0	585,000.0 0
20191218 00000639	600094	大名城	2019年 12月18日	2020年1 月2日	5.85	16,100.00	94,185.00

			日				
20191217 00000412	600098	广州发展	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.54	29,800.00	194,892.0 0
20191227 00000510	600098	广州发展	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	6.54	10,000.00	65,400.00
20191219 00000372	600120	浙江东方	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	8.73	42,400.00	370,152.0 0
20191219 00000369	600125	铁龙物流	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.98	49,900.00	298,402.0 0
20191218 00000660	600126	杭钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.89	55,500.00	271,395.0 0
20191223 00000337	600126	杭钢股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	4.89	600,000.0 0	2,934,000 .00
20191217 00000431	600132	重庆啤酒	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	51.96	11,200.00	581,952.0 0
20191217 00000361	600138	中青旅	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	12.60	30,700.00	386,820.0 0
20191223 00000321	600138	中青旅	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	12.60	250,000.0 0	3,150,000 .00
20191217 00000346	600141	兴发集团	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.28	31,000.00	318,680.0 0
20191226 00000203	600141	兴发集团	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	10.28	33,100.00	340,268.0 0
20191218 00000568	600143	金发科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	7.28	14,100.00	102,648.0 0
20191218 00000446	600143	金发科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.28	93,900.00	683,592.0 0
20191219 00000351	600143	金发科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	7.28	21,000.00	152,880.0 0
20191217	600150	中国船舶	2019 年	2020 年 1	21.76	35,300.00	768,128.0

00000463			12月17日	月14日			0
20191217 00000471	600150	中国船舶	2019年 12月17日	2020年1 月14日	21.76	40,000.00	870,400.0 0
20191218 00000624	600150	中国船舶	2019年 12月18日	2020年1 月15日	21.76	139,900.0 0	3,044,224 .00
20191220 00000209	600150	中国船舶	2019年 12月20日	2020年1 月17日	21.76	100,000.0 0	2,176,000 .00
20191223 00000318	600150	中国船舶	2019年 12月23日	2020年1 月20日	21.76	46,000.00	1,000,960 .00
20191204 00000246	600155	华创阳安	2019年 12月4日	2020年1 月2日	14.03	50,000.00	701,500.0 0
20191205 00000359	600155	华创阳安	2019年 12月5日	2020年1 月2日	14.03	220,000.0 0	3,086,600 .00
20191211 00000372	600155	华创阳安	2019年 12月11日	2020年1 月8日	14.03	180,000.0 0	2,525,400 .00
20191212 00000147	600155	华创阳安	2019年 12月12日	2020年1 月9日	14.03	20,000.00	280,600.0 0
20191217 00000365	600155	华创阳安	2019年 12月17日	2020年1 月14日	14.03	36,800.00	516,304.0 0
20191220 00000196	600155	华创阳安	2019年 12月20日	2020年1 月17日	14.03	60,000.00	841,800.0 0
20191224 00000248	600155	华创阳安	2019年 12月24日	2020年1 月7日	14.03	50,000.00	701,500.0 0
20191225 00000199	600155	华创阳安	2019年 12月25日	2020年1 月22日	14.03	200,000.0 0	2,806,000 .00
20191226 00000198	600155	华创阳安	2019年 12月26日	2020年1 月23日	14.03	27,100.00	380,213.0 0
20191217 00000427	600158	中体产业	2019年 12月17日	2020年1 月14日	10.03	36,400.00	365,092.0 0
20191227 00000492	600158	中体产业	2019年 12月27日	2020年2 月3日	10.03	42,000.00	421,260.0 0

			日				
20191218 00000470	600160	巨化股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.28	72,600.00	528,528.0 0
20191227 00000541	600160	巨化股份	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	7.28	45,800.00	333,424.0 0
20191217 00000359	600161	天坛生物	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	27.94	28,200.00	787,908.0 0
20191218 00000623	600166	福田汽车	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.09	240,600.0 0	502,854.0 0
20191217 00000298	600167	联美控股	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.16	38,400.00	505,344.0 0
20191223 00000255	600167	联美控股	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	13.16	240,000.0 0	3,158,400 .00
20191217 00000324	600171	上海贝岭	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.75	28,300.00	445,725.0 0
20191223 00000343	600171	上海贝岭	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	15.75	64,000.00	1,008,000 .00
20191218 00000643	600201	生物股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	18.72	63,400.00	1,186,848 .00
20191217 00000479	600216	浙江医药	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.35	32,400.00	432,540.0 0
20191218 00000542	600256	广汇能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.31	220,100.0 0	728,531.0 0
20191217 00000297	600258	首旅酒店	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.61	25,000.00	515,250.0 0
20191226 00000187	600258	首旅酒店	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	20.61	32,200.00	663,642.0 0
20191204 00000290	600259	广晟有色	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	34.77	20,000.00	695,400.0 0
20191204 00000295	600259	广晟有色	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	34.77	20,000.00	695,400.0 0

20191205 00000421	600259	广晟有色	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	34.77	32,000.00	1,112,640 .00
20191210 00000741	600259	广晟有色	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	34.77	20,000.00	695,400.0 0
20191212 00000201	600259	广晟有色	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	34.77	10,000.00	347,700.0 0
20191213 00000141	600259	广晟有色	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	34.77	10,000.00	347,700.0 0
20191219 00000428	600259	广晟有色	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	34.77	20,000.00	695,400.0 0
20191224 00000316	600259	广晟有色	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	34.77	10,000.00	347,700.0 0
20191205 00000288	600260	凯乐科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	13.57	82,000.00	1,112,740 .00
20191219 00000273	600260	凯乐科技	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	13.57	40,500.00	549,585.0 0
20191218 00000414	600266	城建发展	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.10	61,300.00	496,530.0 0
20191219 00000338	600273	嘉化能源	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	11.25	60,700.00	682,875.0 0
20191205 00000413	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	4.56	480,000.0 0	2,188,800 .00
20191210 00000733	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	4.56	210,000.0 0	957,600.0 0
20191212 00000196	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	4.56	75,100.00	342,456.0 0
20191218 00000584	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	4.56	24,100.00	109,896.0 0
20191218 00000612	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.56	72,400.00	330,144.0 0
20191218 00000588	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 18	2020 年 1 月 15 日	4.56	73,400.00	334,704.0 0

			日				
20191224 00000312	600277	亿利洁能	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	4.56	20,000.00	91,200.00
20191218 00000497	600282	南钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.45	141,400.0 0	487,830.0 0
20191212 00000156	600291	西水股份	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	8.99	56,000.00	503,440.0 0
20191217 00000357	600291	西水股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	8.99	34,900.00	313,751.0 0
20191218 00000644	600291	西水股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	8.99	11,200.00	100,688.0 0
20191220 00000189	600291	西水股份	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.99	40,000.00	359,600.0 0
20191217 00000418	600298	安琪酵母	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	30.67	27,900.00	855,693.0 0
20191212 00000153	600307	酒钢宏兴	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	2.06	16,100.00	33,166.00
20191218 00000519	600307	酒钢宏兴	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.06	171,300.0 0	352,878.0 0
20191219 00000343	600307	酒钢宏兴	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	2.06	20,000.00	41,200.00
20191219 00000286	600312	平高电气	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	6.46	46,500.00	300,390.0 0
20191223 00000322	600312	平高电气	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	6.46	460,000.0 0	2,971,600 .00
20191219 00000365	600315	上海家化	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	30.94	18,300.00	566,202.0 0
20191217 00000377	600316	洪都航空	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.03	23,900.00	311,417.0 0
20191218	600317	营 口 港	2019 年	2020 年 1	2.55	107,300.0	273,615.0

00000449			12月18日	月15日		0	0
20191212 00000181	600325	华发股份	2019年 12月12日	2020年1 月9日	7.83	20,000.00	156,600.0 0
20191217 00000443	600325	华发股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	7.83	500,000.0 0	3,915,000 .00
20191218 00000590	600325	华发股份	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.83	36,600.00	286,578.0 0
20191218 00000577	600325	华发股份	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.83	82,600.00	646,758.0 0
20191219 00000267	600329	中新药业	2019年 12月19日	2020年1 月16日	13.86	15,800.00	218,988.0 0
20191217 00000353	600335	国机汽车	2019年 12月17日	2020年1 月14日	5.80	23,400.00	135,720.0 0
20191218 00000587	600335	国机汽车	2019年 12月18日	2020年1 月2日	5.80	17,300.00	100,340.0 0
20191218 00000642	600339	中油工程	2019年 12月18日	2020年1 月2日	3.39	29,000.00	98,310.00
20191218 00000586	600339	中油工程	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.39	88,000.00	298,320.0 0
20191218 00000523	600348	阳泉煤业	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.53	66,300.00	366,639.0 0
20191223 00000306	600348	阳泉煤业	2019年 12月23日	2020年1 月20日	5.53	570,000.0 0	3,152,100 .00
20191217 00000410	600350	山东高速	2019年 12月17日	2020年1 月14日	4.91	36,300.00	178,233.0 0
20191217 00000310	600373	中文传媒	2019年 12月17日	2020年1 月14日	13.61	36,100.00	491,321.0 0
20191218 00000609	600376	首开股份	2019年 12月18日	2020年1 月2日	7.97	12,500.00	99,625.00

20191218 00000538	600376	首开股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.97	70,600.00	562,682.0 0
20191223 00000338	600376	首开股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	7.97	380,000.0 0	3,028,600 .00
20191218 00000433	600380	健康元	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	10.35	10,100.00	104,535.0 0
20191218 00000462	600380	健康元	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	10.35	54,200.00	560,970.0 0
20191219 00000306	600388	龙净环保	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	9.75	41,900.00	408,525.0 0
20191223 00000270	600388	龙净环保	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	9.75	310,000.0 0	3,022,500 .00
20191218 00000535	600392	盛和资源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	9.07	11,200.00	101,584.0 0
20191218 00000649	600392	盛和资源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.07	56,000.00	507,920.0 0
20191218 00000561	600409	三友化工	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.32	65,200.00	412,064.0 0
20191204 00000215	600410	华胜天成	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	10.31	10,000.00	103,100.0 0
20191209 00000390	600410	华胜天成	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	10.31	50,000.00	515,500.0 0
20191211 00000347	600410	华胜天成	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	10.31	97,000.00	1,000,070 .00
20191213 00000131	600410	华胜天成	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	10.31	20,000.00	206,200.0 0
20191217 00000320	600410	华胜天成	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.31	369,800.0 0	3,812,638 .00
20191224 00000219	600410	华胜天成	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	10.31	60,000.00	618,600.0 0
20191225	600410	华胜天成	2019 年	2020 年 1	10.31	20,000.00	206,200.0

00000175			12月25日	月22日			0
20191218 00000515	600415	小商品城	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.87	153,800.0 0	595,206.0 0
20191218 00000447	600418	江淮汽车	2019年 12月18日	2020年1 月2日	5.02	20,000.00	100,400.0 0
20191218 00000437	600418	江淮汽车	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.02	71,700.00	359,934.0 0
20191223 00000305	600418	江淮汽车	2019年 12月23日	2020年1 月20日	5.02	600,000.0 0	3,012,000 .00
20191218 00000486	600426	华鲁恒升	2019年 12月18日	2020年1 月15日	19.87	59,600.00	1,184,252 .00
20191218 00000549	600428	中远海特	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.74	57,200.00	213,928.0 0
20191218 00000573	600435	北方导航	2019年 12月18日	2020年1 月15日	8.32	56,500.00	470,080.0 0
20191219 00000432	600435	北方导航	2019年 12月19日	2020年1 月2日	8.32	18,000.00	149,760.0 0
20191220 00000224	600435	北方导航	2019年 12月20日	2020年1 月3日	8.32	11,800.00	98,176.00
20191220 00000216	600435	北方导航	2019年 12月20日	2020年1 月17日	8.32	100,000.0 0	832,000.0 0
20191217 00000360	600446	金证股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	20.58	29,700.00	611,226.0 0
20191217 00000362	600446	金证股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	20.58	110,000.0 0	2,263,800 .00
20191218 00000458	600446	金证股份	2019年 12月18日	2020年1 月15日	20.58	70,000.00	1,440,600 .00
20191218 00000493	600446	金证股份	2019年 12月18日	2020年1 月15日	20.58	200,000.0 0	4,116,000 .00

20191219 00000314	600446	金证股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	20.58	100,000.0 0	2,058,000 .00
20191227 00000502	600446	金证股份	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	20.58	16,000.00	329,280.0 0
20191204 00000274	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	15.47	420,000.0 0	6,497,400 .00
20191211 00000395	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	15.47	190,000.0 0	2,939,300 .00
20191212 00000177	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.47	25,000.00	386,750.0 0
20191212 00000180	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	15.47	40,000.00	618,800.0 0
20191213 00000128	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.47	10,000.00	154,700.0 0
20191213 00000157	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.47	30,000.00	464,100.0 0
20191213 00000158	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	15.47	10,000.00	154,700.0 0
20191217 00000428	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	15.47	50,000.00	773,500.0 0
20191224 00000276	600460	士 兰 微	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	15.47	19,900.00	307,853.0 0
20191218 00000533	600466	蓝光发展	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	7.37	14,100.00	103,917.0 0
20191218 00000652	600466	蓝光发展	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.37	79,300.00	584,441.0 0
20191204 00000207	600478	科 力 远	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	4.40	540,000.0 0	2,376,000 .00
20191218 00000411	600478	科 力 远	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.40	64,900.00	285,560.0 0
20191223	600478	科 力 远	2019 年	2020 年 1	4.40	720,000.0	3,168,000

00000259			12月23日	月20日		0	.00
20191223 00000272	600478	科力远	2019年 12月23日	2020年1 月20日	4.40	95,000.00	418,000.0 0
20191219 00000396	600486	扬农化工	2019年 12月19日	2020年1 月16日	68.63	10,000.00	686,300.0 0
20191218 00000491	600497	驰宏锌锗	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.38	135,900.0 0	595,242.0 0
20191218 00000647	600499	科达洁能	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.33	69,600.00	301,368.0 0
20191218 00000492	600500	中化国际	2019年 12月18日	2020年1 月15日	5.30	73,500.00	389,550.0 0
20191217 00000455	600507	方大特钢	2019年 12月17日	2020年1 月14日	10.06	35,800.00	360,148.0 0
20191217 00000465	600507	方大特钢	2019年 12月17日	2020年1 月14日	10.06	100,000.0 0	1,006,000 .00
20191220 00000237	600507	方大特钢	2019年 12月20日	2020年1 月17日	10.06	50,000.00	503,000.0 0
20191219 00000388	600511	国药股份	2019年 12月19日	2020年1 月16日	27.29	16,900.00	461,201.0 0
20191218 00000641	600515	海航基础	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.46	87,400.00	389,804.0 0
20191225 00000202	600515	海航基础	2019年 12月25日	2020年1 月22日	4.46	120,000.0 0	535,200.0 0
20191225 00000204	600515	海航基础	2019年 12月25日	2020年1 月22日	4.46	120,000.0 0	535,200.0 0
20191225 00000205	600515	海航基础	2019年 12月25日	2020年1 月22日	4.46	20,000.00	89,200.00
20191227 00000474	600515	海航基础	2019年 12月27日	2020年2 月3日	4.46	89,000.00	396,940.0 0

20191227 00000479	600515	海航基础	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	4.46	10,000.00	44,600.00
20191217 00000477	600521	华海药业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	17.26	39,700.00	685,222.0 0
20191218 00000636	600528	中铁工业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	11.50	58,900.00	677,350.0 0
20191204 00000249	600536	中国软件	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	71.69	30,000.00	2,150,700 .00
20191204 00000252	600536	中国软件	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	71.69	130,000.0 0	9,319,700 .00
20191205 00000369	600536	中国软件	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	71.69	20,000.00	1,433,800 .00
20191205 00000372	600536	中国软件	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	71.69	90,000.00	6,452,100 .00
20191211 00000384	600536	中国软件	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	71.69	70,000.00	5,018,300 .00
20191212 00000155	600536	中国软件	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	71.69	30,000.00	2,150,700 .00
20191213 00000138	600536	中国软件	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	71.69	10,000.00	716,900.0 0
20191217 00000401	600536	中国软件	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	71.69	10,000.00	716,900.0 0
20191219 00000355	600536	中国软件	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	71.69	50,000.00	3,584,500 .00
20191219 00000356	600536	中国软件	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	71.69	20,000.00	1,433,800 .00
20191219 00000357	600536	中国软件	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	71.69	40,000.00	2,867,600 .00
20191204 00000225	600545	卓郎智能	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	6.07	420,000.0 0	2,549,400 .00
20191213 00000139	600545	卓郎智能	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	6.07	164,200.0 0	996,694.0 0
20191219	600545	卓郎智能	2019 年	2020 年 1	6.07	51,500.00	312,605.0

00000301			12月19日	月16日			0
20191227 00000402	600545	卓郎智能	2019年 12月27日	2020年2 月3日	6.07	66,000.00	400,620.0 0
20191219 00000435	600549	厦门钨业	2019年 12月19日	2020年1 月16日	13.04	46,300.00	603,752.0 0
20191219 00000408	600557	康缘药业	2019年 12月19日	2020年1 月16日	14.74	23,100.00	340,494.0 0
20191219 00000342	600563	法拉电子	2019年 12月19日	2020年1 月16日	49.45	10,000.00	494,500.0 0
20191218 00000487	600565	迪马股份	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.58	76,200.00	272,796.0 0
20191212 00000159	600567	山鹰纸业	2019年 12月12日	2020年1 月9日	3.77	152,900.0 0	576,433.0 0
20191218 00000524	600567	山鹰纸业	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.77	174,900.0 0	659,373.0 0
20191220 00000193	600567	山鹰纸业	2019年 12月20日	2020年1 月17日	3.77	70,000.00	263,900.0 0
20191223 00000331	600567	山鹰纸业	2019年 12月23日	2020年1 月20日	3.77	113,000.0 0	426,010.0 0
20191227 00000444	600567	山鹰纸业	2019年 12月27日	2020年2 月3日	3.77	110,000.0 0	414,700.0 0
20191210 00000509	600572	康恩贝	2019年 12月10日	2020年1 月7日	6.15	80,000.00	492,000.0 0
20191212 00000150	600572	康恩贝	2019年 12月12日	2020年1 月9日	6.15	49,500.00	304,425.0 0
20191218 00000530	600572	康恩贝	2019年 12月18日	2020年1 月2日	6.15	40,300.00	247,845.0 0
20191218 00000415	600572	康恩贝	2019年 12月18日	2020年1 月15日	6.15	105,600.0 0	649,440.0 0

20191219 00000317	600572	康恩贝	2019年 12月19 日	2020年1 月2日	6.15	24,000.00	147,600.0 0
20191220 00000154	600572	康恩贝	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	6.15	400,000.0 0	2,460,000 .00
20191218 00000476	600575	淮河能源	2019年 12月18 日	2020年1 月2日	2.57	38,400.00	98,688.00
20191218 00000417	600575	淮河能源	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	2.57	87,600.00	225,132.0 0
20191219 00000270	600575	淮河能源	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	2.57	113,200.0 0	290,924.0 0
20191219 00000298	600580	卧龙电驱	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	12.02	41,800.00	502,436.0 0
20191218 00000440	600582	天地科技	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	3.19	90,600.00	289,014.0 0
20191205 00000282	600584	长电科技	2019年 12月5日	2020年1 月2日	21.98	90,000.00	1,978,200 .00
20191206 00000215	600584	长电科技	2019年 12月6日	2020年1 月3日	21.98	200,000.0 0	4,396,000 .00
20191209 00000350	600584	长电科技	2019年 12月9日	2020年1 月6日	21.98	60,000.00	1,318,800 .00
20191210 00000514	600584	长电科技	2019年 12月10 日	2020年1 月7日	21.98	60,000.00	1,318,800 .00
20191210 00000517	600584	长电科技	2019年 12月10 日	2020年1 月7日	21.98	100,000.0 0	2,198,000 .00
20191212 00000154	600584	长电科技	2019年 12月12 日	2020年1 月9日	21.98	45,000.00	989,100.0 0
20191212 00000157	600584	长电科技	2019年 12月12 日	2020年1 月9日	21.98	56,000.00	1,230,880 .00
20191213 00000104	600584	长电科技	2019年 12月13 日	2020年1 月10日	21.98	43,000.00	945,140.0 0
20191213 00000105	600584	长电科技	2019年 12月13 日	2020年1 月10日	21.98	20,000.00	439,600.0 0

			日				
20191218 00000450	600584	长电科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	21.98	25,000.00	549,500.0 0
20191218 00000427	600584	长电科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	21.98	56,000.00	1,230,880 .00
20191218 00000431	600584	长电科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	21.98	20,000.00	439,600.0 0
20191225 00000172	600584	长电科技	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	21.98	150,000.0 0	3,297,000 .00
20191217 00000349	600597	光明乳业	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	12.69	32,800.00	416,232.0 0
20191223 00000297	600597	光明乳业	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	12.69	260,000.0 0	3,299,400 .00
20191217 00000358	600598	北大荒	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	9.74	38,700.00	376,938.0 0
20191217 00000426	600623	华谊集团	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.65	30,800.00	204,820.0 0
20191219 00000310	600633	浙数文化	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	9.15	42,200.00	386,130.0 0
20191223 00000281	600633	浙数文化	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	9.15	340,000.0 0	3,111,000 .00
20191219 00000366	600639	浦东金桥	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	13.50	18,300.00	247,050.0 0
20191212 00000188	600640	号百控股	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	25.81	39,300.00	1,014,333 .00
20191217 00000464	600640	号百控股	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.81	49,000.00	1,264,690 .00
20191217 00000470	600640	号百控股	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	25.81	88,000.00	2,271,280 .00
20191217	600640	号百控股	2019 年	2020 年 1	25.81	30,000.00	774,300.0

00000450			12 月 17 日	月 14 日			0
20191218 00000656	600640	号百控股	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	25.81	13,100.00	338,111.0 0
20191218 00000646	600640	号百控股	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	25.81	30,000.00	774,300.0 0
20191219 00000403	600640	号百控股	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.81	40,000.00	1,032,400 .00
20191219 00000406	600640	号百控股	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.81	15,700.00	405,217.0 0
20191219 00000409	600640	号百控股	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.81	130,000.0 0	3,355,300 .00
20191219 00000412	600640	号百控股	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	25.81	76,000.00	1,961,560 .00
20191220 00000213	600640	号百控股	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	25.81	40,000.00	1,032,400 .00
20191220 00000214	600640	号百控股	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	25.81	50,000.00	1,290,500 .00
20191220 00000215	600640	号百控股	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	25.81	40,000.00	1,032,400 .00
20191218 00000657	600642	申能股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.81	136,500.0 0	793,065.0 0
20191219 00000405	600643	爱建集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	9.60	51,300.00	492,480.0 0
20191219 00000402	600645	中源协和	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	16.93	17,800.00	301,354.0 0
20191226 00000175	600645	中源协和	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	16.93	10,000.00	169,300.0 0
20191212 00000193	600648	外高桥	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	17.37	29,500.00	512,415.0 0

20191217 00000473	600648	外高桥	2019年 12月17 日	2020年1 月14日	17.37	20,000.00	347,400.0 0
20191223 00000353	600648	外高桥	2019年 12月23 日	2020年1 月20日	17.37	17,000.00	295,290.0 0
20191224 00000296	600648	外高桥	2019年 12月24 日	2020年1 月21日	17.37	30,000.00	521,100.0 0
20191227 00000411	600648	外高桥	2019年 12月27 日	2020年1 月10日	17.37	10,000.00	173,700.0 0
20191218 00000452	600649	城投控股	2019年 12月18 日	2020年1 月2日	5.72	17,400.00	99,528.00
20191218 00000480	600649	城投控股	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	5.72	68,800.00	393,536.0 0
20191219 00000291	600657	信达地产	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	3.99	46,800.00	186,732.0 0
20191223 00000339	600657	信达地产	2019年 12月23 日	2020年1 月20日	3.99	780,000.0 0	3,112,200 .00
20191218 00000521	600664	哈药股份	2019年 12月18 日	2020年1 月2日	3.79	26,800.00	101,572.0 0
20191218 00000620	600664	哈药股份	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	3.79	87,900.00	333,141.0 0
20191223 00000357	600664	哈药股份	2019年 12月23 日	2020年1 月20日	3.79	820,000.0 0	3,107,800 .00
20191218 00000602	600673	东阳光	2019年 12月18 日	2020年1 月15日	10.24	84,100.00	861,184.0 0
20191219 00000327	600694	大商股份	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	27.39	10,000.00	273,900.0 0
20191219 00000263	600699	均胜电子	2019年 12月19 日	2020年1 月2日	17.90	27,400.00	490,460.0 0
20191219 00000299	600699	均胜电子	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	17.90	42,100.00	753,590.0 0

			日				
20191225 00000168	600699	均胜电子	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 8 日	17.90	20,000.00	358,000.0 0
20191218 00000625	600704	物产中大	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.25	138,000.0 0	724,500.0 0
20191217 00000331	600707	彩虹股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	4.20	180,000.0 0	756,000.0 0
20191217 00000337	600707	彩虹股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	4.20	310,000.0 0	1,302,000 .00
20191217 00000345	600707	彩虹股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	4.20	730,000.0 0	3,066,000 .00
20191217 00000348	600707	彩虹股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	4.20	300,000.0 0	1,260,000 .00
20191218 00000663	600717	天津港	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.28	56,300.00	353,564.0 0
20191219 00000300	600718	东软集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	11.35	45,400.00	515,290.0 0
20191218 00000444	600728	佳都科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.38	70,100.00	657,538.0 0
20191217 00000288	600729	重庆百货	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	29.85	12,800.00	382,080.0 0
20191218 00000461	600737	中粮糖业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.46	59,100.00	499,986.0 0
20191218 00000441	600739	辽宁成大	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	15.23	68,700.00	1,046,301 .00
20191219 00000398	600739	辽宁成大	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 2 日	15.23	10,000.00	152,300.0 0
20191204 00000224	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	92.50	50,000.00	4,625,000 .00
20191204 00000230	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	92.50	30,000.00	2,775,000 .00

20191204 00000234	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	92.50	100,000.0 0	9,250,000 .00
20191204 00000237	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	92.50	60,000.00	5,550,000 .00
20191205 00000291	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	92.50	110,000.0 0	10,175,00 0.00
20191205 00000293	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	92.50	30,000.00	2,775,000 .00
20191209 00000359	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	92.50	10,000.00	925,000.0 0
20191210 00000522	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	92.50	12,000.00	1,110,000 .00
20191212 00000161	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	92.50	20,000.00	1,850,000 .00
20191217 00000308	600745	闻泰科技	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	92.50	21,600.00	1,998,000 .00
20191219 00000302	600748	上实发展	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.94	51,500.00	305,910.0 0
20191218 00000419	600751	海航科技	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.93	99,900.00	292,707.0 0
20191219 00000309	600754	锦江酒店	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	28.71	16,200.00	465,102.0 0
20191218 00000418	600755	厦门国贸	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.34	69,500.00	510,130.0 0
20191217 00000481	600757	长江传媒	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	6.16	33,100.00	203,896.0 0
20191209 00000540	600759	洲际油气	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	2.77	400,000.0 0	1,108,000 .00
20191218 00000589	600759	洲际油气	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	2.77	36,100.00	99,997.00
20191218 00000635	600759	洲际油气	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.77	88,600.00	245,422.0 0
20191213 00000149	600763	通策医疗	2019 年 12 月 13	2020 年 1 月 10 日	102.53	10,000.00	1,025,300 .00

			日				
20191217 00000424	600763	通策医疗	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	102.53	10,500.00	1,076,565 .00
20191217 00000417	600765	中航重机	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	10.23	27,600.00	282,348.0 0
20191224 00000281	600765	中航重机	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	10.23	40,000.00	409,200.0 0
20191217 00000416	600770	综艺股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	5.39	39,800.00	214,522.0 0
20191219 00000362	600770	综艺股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.39	200,000.0 0	1,078,000 .00
20191217 00000385	600776	东方通信	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.83	66,500.00	1,385,195 .00
20191217 00000387	600776	东方通信	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.83	440,000.0 0	9,165,200 .00
20191217 00000389	600776	东方通信	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.83	50,000.00	1,041,500 .00
20191217 00000390	600776	东方通信	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	20.83	390,000.0 0	8,123,700 .00
20191212 00000190	600777	新潮能源	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	2.10	220,000.0 0	462,000.0 0
20191218 00000557	600777	新潮能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.10	224,200.0 0	470,820.0 0
20191206 00000306	600779	水井坊	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	51.75	17,000.00	879,750.0 0
20191217 00000404	600779	水井坊	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	51.75	10,900.00	564,075.0 0
20191218 00000637	600782	新钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.13	84,700.00	434,511.0 0
20191219 00000304	600787	中储股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.21	47,900.00	249,559.0 0

			日				
20191226 00000178	600787	中储股份	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	5.21	96,200.00	501,202.0 0
20191204 00000275	600801	华新水泥	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	26.43	90,000.00	2,378,700 .00
20191217 00000451	600801	华新水泥	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	26.43	37,900.00	1,001,697 .00
20191220 00000239	600801	华新水泥	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	26.43	13,000.00	343,590.0 0
20191223 00000298	600801	华新水泥	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	26.43	140,000.0 0	3,700,200 .00
20191218 00000445	600804	鹏博士	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.12	77,000.00	471,240.0 0
20191218 00000455	600808	马钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	3.07	51,700.00	158,719.0 0
20191218 00000603	600808	马钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.07	157,000.0 0	481,990.0 0
20191218 00000420	600811	东方集团	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.36	164,900.0 0	554,064.0 0
20191218 00000478	600820	隧道股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.04	103,600.0 0	625,744.0 0
20191212 00000137	600823	世茂股份	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	4.50	72,400.00	325,800.0 0
20191218 00000554	600823	世茂股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.50	78,600.00	353,700.0 0
20191223 00000345	600823	世茂股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	4.50	720,000.0 0	3,240,000 .00
20191227 00000582	600823	世茂股份	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	4.50	33,000.00	148,500.0 0
20191219 00000400	600827	百联股份	2019 年 12 月 19	2020 年 1 月 16 日	8.98	44,100.00	396,018.0 0

			日				
20191219 00000399	600835	上海机电	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	16.57	16,700.00	276,719.0 0
20191206 00000264	600839	四川长虹	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	2.91	350,000.0 0	1,018,500 .00
20191212 00000164	600839	四川长虹	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	2.91	27,200.00	79,152.00
20191218 00000502	600839	四川长虹	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.91	199,700.0 0	581,127.0 0
20191219 00000316	600845	宝信软件	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	32.90	18,600.00	611,940.0 0
20191220 00000197	600845	宝信软件	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	32.90	80,000.00	2,632,000 .00
20191224 00000243	600845	宝信软件	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	32.90	10,000.00	329,000.0 0
20191217 00000475	600859	王府井	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	13.99	20,000.00	279,800.0 0
20191219 00000439	600859	王府井	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	13.99	21,300.00	297,987.0 0
20191212 00000151	600862	中航高科	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	11.02	10,000.00	110,200.0 0
20191217 00000373	600862	中航高科	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	11.02	28,500.00	314,070.0 0
20191209 00000355	600863	内蒙华电	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	2.75	280,000.0 0	770,000.0 0
20191218 00000613	600863	内蒙华电	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	2.75	36,900.00	101,475.0 0
20191218 00000443	600863	内蒙华电	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.75	155,700.0 0	428,175.0 0
20191223 00000269	600863	内蒙华电	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	2.75	1,000,000 .00	2,750,000 .00

20191223 00000276	600863	内蒙华电	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	2.75	120,000.0 0	330,000.0 0
20191204 00000229	600869	智慧能源	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	4.90	100,000.0 0	490,000.0 0
20191206 00000246	600869	智慧能源	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	4.90	352,000.0 0	1,724,800 .00
20191211 00000354	600869	智慧能源	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	4.90	210,000.0 0	1,029,000 .00
20191218 00000559	600869	智慧能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	4.90	20,500.00	100,450.0 0
20191218 00000489	600869	智慧能源	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.90	64,600.00	316,540.0 0
20191227 00000427	600869	智慧能源	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	4.90	84,000.00	411,600.0 0
20191217 00000339	600874	创业环保	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	7.19	24,000.00	172,560.0 0
20191218 00000629	600875	东方电气	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.19	60,300.00	554,157.0 0
20191223 00000284	600875	东方电气	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	9.19	330,000.0 0	3,032,700 .00
20191213 00000133	600879	航天电子	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	5.98	20,800.00	124,384.0 0
20191218 00000614	600879	航天电子	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.98	121,700.0 0	727,766.0 0
20191218 00000653	600881	亚泰集团	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.19	177,900.0 0	567,501.0 0
20191219 00000379	600884	杉杉股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	13.51	41,500.00	560,665.0 0
20191217 00000511	600885	宏发股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	34.45	24,200.00	833,690.0 0
20191206	600895	张江高科	2019 年	2020 年 1	15.31	70,000.00	1,071,700

00000292			12月6日	月3日			.00
20191211 00000391	600895	张江高科	2019年 12月11日	2020年1 月8日	15.31	30,000.00	459,300.0 0
20191219 00000370	600895	张江高科	2019年 12月19日	2020年1 月16日	15.31	41,600.00	636,896.0 0
20191219 00000272	600901	江苏租赁	2019年 12月19日	2020年1 月16日	6.32	49,400.00	312,208.0 0
20191217 00000468	600903	贵州燃气	2019年 12月17日	2020年1 月14日	14.78	38,200.00	564,596.0 0
20191217 00000472	600903	贵州燃气	2019年 12月17日	2020年1 月14日	14.78	100,000.0 0	1,478,000 .00
20191217 00000317	600909	华安证券	2019年 12月17日	2020年1 月14日	7.30	600,000.0 0	4,380,000 .00
20191218 00000576	600909	华安证券	2019年 12月18日	2020年1 月2日	7.30	120,000.0 0	876,000.0 0
20191218 00000475	600909	华安证券	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.30	508,200.0 0	3,709,860 .00
20191218 00000479	600909	华安证券	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.30	260,000.0 0	1,898,000 .00
20191218 00000482	600909	华安证券	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.30	1,000,000 .00	7,300,000 .00
20191218 00000485	600909	华安证券	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.30	560,000.0 0	4,088,000 .00
20191218 00000488	600909	华安证券	2019年 12月18日	2020年1 月15日	7.30	114,000.0 0	832,200.0 0
20191219 00000295	600909	华安证券	2019年 12月19日	2020年1 月16日	7.30	170,000.0 0	1,241,000 .00
20191219 00000297	600909	华安证券	2019年 12月19日	2020年1 月16日	7.30	170,000.0 0	1,241,000 .00
20191220	600909	华安证券	2019年	2020年1	7.30	80,000.00	584,000.0

00000202			12月20日	月3日			0
20191220 00000169	600909	华安证券	2019年 12月20日	2020年1 月17日	7.30	30,000.00	219,000.0 0
20191220 00000172	600909	华安证券	2019年 12月20日	2020年1 月17日	7.30	80,000.00	584,000.0 0
20191204 00000281	600917	重庆燃气	2019年 12月4日	2020年1 月2日	7.26	70,000.00	508,200.0 0
20191206 00000311	600917	重庆燃气	2019年 12月6日	2020年1 月3日	7.26	140,000.0 0	1,016,400 .00
20191217 00000490	600917	重庆燃气	2019年 12月17日	2020年1 月14日	7.26	140,000.0 0	1,016,400 .00
20191217 00000501	600917	重庆燃气	2019年 12月17日	2020年1 月14日	7.26	10,400.00	75,504.00
20191224 00000297	600917	重庆燃气	2019年 12月24日	2020年1 月21日	7.26	30,000.00	217,800.0 0
20191218 00000448	600959	江苏有线	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.98	139,100.0 0	553,618.0 0
20191219 00000312	600967	内蒙一机	2019年 12月19日	2020年1 月16日	10.63	44,700.00	475,161.0 0
20191218 00000569	600970	中材国际	2019年 12月18日	2020年1 月15日	6.97	54,900.00	382,653.0 0
20191212 00000168	600996	贵广网络	2019年 12月12日	2020年1 月9日	8.05	17,000.00	136,850.0 0
20191213 00000154	600996	贵广网络	2019年 12月13日	2020年1 月10日	8.05	125,000.0 0	1,006,250 .00
20191213 00000156	600996	贵广网络	2019年 12月13日	2020年1 月10日	8.05	25,000.00	201,250.0 0
20191217 00000415	600996	贵广网络	2019年 12月17日	2020年1 月14日	8.05	125,000.0 0	1,006,250 .00
20191219 00000368	600996	贵广网络	2019年 12月19日	2020年1 月16日	8.05	16,800.00	135,240.0 0

			日				
20191220 00000181	600996	贵广网络	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.05	50,000.00	402,500.0 0
20191213 00000110	601000	唐山港	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	2.60	398,400.0 0	1,035,840 .00
20191218 00000522	601000	唐山港	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.60	164,400.0 0	427,440.0 0
20191219 00000430	601001	大同煤业	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	4.40	45,700.00	201,080.0 0
20191212 00000195	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	5.65	71,000.00	401,150.0 0
20191217 00000508	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	5.65	25,700.00	145,205.0 0
20191218 00000648	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	5.65	27,000.00	152,550.0 0
20191220 00000201	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	5.65	54,600.00	308,490.0 0
20191223 00000369	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	5.65	186,000.0 0	1,050,900 .00
20191224 00000308	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	5.65	20,000.00	113,000.0 0
20191225 00000212	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	5.65	372,000.0 0	2,101,800 .00
20191226 00000205	601003	柳钢股份	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 9 日	5.65	93,100.00	526,015.0 0
20191218 00000626	601005	重庆钢铁	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	1.85	330,900.0 0	612,165.0 0
20191227 00000530	601005	重庆钢铁	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	1.85	500,000.0 0	925,000.0 0
20191218	601016	节能风电	2019 年	2020 年 1	2.41	91,000.00	219,310.0

00000608			12月18日	月15日			0
20191217 00000300	601098	中南传媒	2019年 12月17日	2020年1 月14日	11.94	38,900.00	464,466.0 0
20191219 00000271	601098	中南传媒	2019年 12月19日	2020年1 月16日	11.94	260,000.0 0	3,104,400 .00
20191218 00000566	601099	太平洋	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.79	345,400.0 0	1,309,066 .00
20191227 00000601	601099	太平洋	2019年 12月27日	2020年1 月10日	3.79	30,000.00	113,700.0 0
20191211 00000350	601100	恒立液压	2019年 12月11日	2020年1 月8日	49.75	22,000.00	1,094,500 .00
20191219 00000318	601100	恒立液压	2019年 12月19日	2020年1 月16日	49.75	13,700.00	681,575.0 0
20191218 00000611	601106	中国一重	2019年 12月18日	2020年1 月15日	2.91	150,600.0 0	438,246.0 0
20191218 00000655	601118	海南橡胶	2019年 12月18日	2020年1 月15日	4.92	91,200.00	448,704.0 0
20191226 00000217	601118	海南橡胶	2019年 12月26日	2020年1 月9日	4.92	68,900.00	338,988.0 0
20191219 00000382	601127	小康股份	2019年 12月19日	2020年1 月16日	11.40	15,600.00	177,840.0 0
20191220 00000184	601127	小康股份	2019年 12月20日	2020年1 月3日	11.40	24,300.00	277,020.0 0
20191223 00000348	601127	小康股份	2019年 12月23日	2020年1 月20日	11.40	35,000.00	399,000.0 0
20191224 00000295	601127	小康股份	2019年 12月24日	2020年1 月21日	11.40	10,000.00	114,000.0 0
20191226 00000179	601127	小康股份	2019年 12月26日	2020年1 月9日	11.40	42,900.00	489,060.0 0

20191226 00000233	601127	小康股份	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	11.40	60,000.00	684,000.0 0
20191227 00000560	601127	小康股份	2019 年 12 月 27 日	2020 年 2 月 3 日	11.40	60,000.00	684,000.0 0
20191205 00000274	601128	常熟银行	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	9.11	261,000.0 0	2,377,710 .00
20191212 00000135	601128	常熟银行	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	9.11	10,000.00	91,100.00
20191218 00000600	601128	常熟银行	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	9.11	11,000.00	100,210.0 0
20191218 00000416	601128	常熟银行	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	9.11	140,100.0 0	1,276,311 .00
20191204 00000203	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 4 日	2020 年 1 月 2 日	7.83	10,000.00	78,300.00
20191205 00000279	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 5 日	2020 年 1 月 2 日	7.83	380,000.0 0	2,975,400 .00
20191206 00000210	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	7.83	200,000.0 0	1,566,000 .00
20191217 00000295	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	7.83	29,500.00	230,985.0 0
20191218 00000517	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	7.83	13,000.00	101,790.0 0
20191226 00000174	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 23 日	7.83	10,400.00	81,432.00
20191227 00000434	601139	深圳燃气	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	7.83	43,300.00	339,039.0 0
20191218 00000436	601168	西部矿业	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.62	104,800.0 0	693,776.0 0
20191218 00000510	601179	中国西电	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.64	111,600.0 0	406,224.0 0
20191218 00000618	601228	广州港	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.83	99,600.00	381,468.0 0

20191217 00000368	601231	环旭电子	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.23	160,000.0 0	3,076,800 .00
20191217 00000374	601231	环旭电子	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.23	200,000.0 0	3,846,000 .00
20191217 00000378	601231	环旭电子	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.23	700,000.0 0	13,461,00 0.00
20191217 00000381	601231	环旭电子	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	19.23	300,000.0 0	5,769,000 .00
20191224 00000251	601231	环旭电子	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	19.23	10,000.00	192,300.0 0
20191218 00000553	601233	桐昆股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	14.99	58,600.00	878,414.0 0
20191218 00000511	601326	秦港股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.19	78,200.00	249,458.0 0
20191218 00000638	601333	广深铁路	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.06	185,700.0 0	568,242.0 0
20191218 00000456	601598	中国外运	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	4.26	85,600.00	364,656.0 0
20191223 00000355	601598	中国外运	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	4.26	179,000.0 0	762,540.0 0
20191218 00000621	601608	中信重工	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.72	92,900.00	345,588.0 0
20191219 00000284	601611	中国核建	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	7.13	43,500.00	310,155.0 0
20191206 00000258	601615	明阳智能	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	12.30	100,000.0 0	1,230,000 .00
20191212 00000149	601615	明阳智能	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	12.30	10,000.00	123,000.0 0
20191219 00000336	601615	明阳智能	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	12.30	13,500.00	166,050.0 0

20191218 00000481	601678	滨化股份	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	5.11	58,600.00	299,446.0 0
20191220 00000157	601678	滨化股份	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	5.11	19,500.00	99,645.00
20191209 00000439	601689	拓普集团	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	17.43	70,000.00	1,220,100 .00
20191211 00000374	601689	拓普集团	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	17.43	40,000.00	697,200.0 0
20191219 00000352	601689	拓普集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	17.43	40,000.00	697,200.0 0
20191219 00000353	601689	拓普集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	17.43	370,000.0 0	6,449,100 .00
20191219 00000354	601689	拓普集团	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	17.43	20,000.00	348,600.0 0
20191218 00000451	601699	潞安环能	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	7.26	66,500.00	482,790.0 0
20191218 00000582	601717	郑煤机	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	6.47	58,100.00	375,907.0 0
20191213 00000102	601718	际华集团	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	3.26	320,500.0 0	1,044,830 .00
20191218 00000428	601718	际华集团	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	3.26	122,600.0 0	399,676.0 0
20191220 00000150	601718	际华集团	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	3.26	40,000.00	130,400.0 0
20191219 00000350	601799	星宇股份	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	94.98	10,000.00	949,800.0 0
20191225 00000196	601799	星宇股份	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 22 日	94.98	22,000.00	2,089,560 .00
20191217 00000476	601801	皖新传媒	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	5.48	31,900.00	174,812.0 0

20191217 00000355	601860	紫金银行	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	5.62	278,200.0 0	1,563,484 .00
20191219 00000340	601860	紫金银行	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	5.62	140,000.0 0	786,800.0 0
20191220 00000195	601860	紫金银行	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	5.62	60,000.00	337,200.0 0
20191220 00000177	601860	紫金银行	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	5.62	50,000.00	281,000.0 0
20191220 00000183	601860	紫金银行	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	5.62	260,000.0 0	1,461,200 .00
20191218 00000658	601865	福 莱 特	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	12.13	50,000.00	606,500.0 0
20191218 00000585	601865	福 莱 特	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	12.13	100,000.0 0	1,213,000 .00
20191219 00000397	601865	福 莱 特	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	12.13	10,000.00	121,300.0 0
20191223 00000330	601865	福 莱 特	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	12.13	135,000.0 0	1,637,550 .00
20191218 00000483	601866	中远海发	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 2 日	2.59	38,900.00	100,751.0 0
20191218 00000426	601866	中远海发	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	2.59	218,300.0 0	565,397.0 0
20191220 00000166	601869	长飞光纤	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	33.03	10,000.00	330,300.0 0
20191206 00000230	601872	招商轮船	2019 年 12 月 6 日	2020 年 1 月 3 日	8.26	250,000.0 0	2,065,000 .00
20191209 00000375	601872	招商轮船	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	8.26	430,000.0 0	3,551,800 .00
20191209 00000385	601872	招商轮船	2019 年 12 月 9 日	2020 年 1 月 6 日	8.26	140,000.0 0	1,156,400 .00
20191210 00000536	601872	招商轮船	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	8.26	190,000.0 0	1,569,400 .00

			日				
20191210 00000538	601872	招商轮船	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	8.26	70,000.00	578,200.0 0
20191210 00000540	601872	招商轮船	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	8.26	160,000.0 0	1,321,600 .00
20191212 00000136	601872	招商轮船	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	8.26	170,000.0 0	1,404,200 .00
20191213 00000117	601872	招商轮船	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	8.26	144,500.0 0	1,193,570 .00
20191213 00000121	601872	招商轮船	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	8.26	40,000.00	330,400.0 0
20191213 00000123	601872	招商轮船	2019 年 12 月 13 日	2020 年 1 月 10 日	8.26	60,000.00	495,600.0 0
20191218 00000469	601872	招商轮船	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	8.26	118,300.0 0	977,158.0 0
20191219 00000287	601872	招商轮船	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	8.26	100,000.0 0	826,000.0 0
20191220 00000228	601872	招商轮船	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	8.26	300,000.0 0	2,478,000 .00
20191220 00000231	601872	招商轮船	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	8.26	130,000.0 0	1,073,800 .00
20191220 00000235	601872	招商轮船	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 3 日	8.26	80,000.00	660,800.0 0
20191220 00000165	601872	招商轮船	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.26	260,000.0 0	2,147,600 .00
20191220 00000167	601872	招商轮船	2019 年 12 月 20 日	2020 年 1 月 17 日	8.26	690,000.0 0	5,699,400 .00
20191223 00000332	601872	招商轮船	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	8.26	57,000.00	470,820.0 0
20191224	601872	招商轮船	2019 年	2020 年 1	8.26	370,000.0	3,056,200

00000211			12月24日	月21日		0	.00
20191225 00000218	601872	招商轮船	2019年 12月25日	2020年1 月8日	8.26	300,000.0 0	2,478,000 .00
20191227 00000379	601872	招商轮船	2019年 12月27日	2020年2 月3日	8.26	100,000.0 0	826,000.0 0
20191227 00000384	601872	招商轮船	2019年 12月27日	2020年2 月3日	8.26	10,000.00	82,600.00
20191209 00000406	601880	大连港	2019年 12月9日	2020年1 月6日	2.03	500,000.0 0	1,015,000 .00
20191218 00000464	601880	大连港	2019年 12月18日	2020年1 月15日	2.03	500,000.0 0	1,015,000 .00
20191218 00000474	601880	大连港	2019年 12月18日	2020年1 月15日	2.03	170,800.0 0	346,724.0 0
20191220 00000200	601880	大连港	2019年 12月20日	2020年1 月17日	2.03	500,000.0 0	1,015,000 .00
20191224 00000246	601880	大连港	2019年 12月24日	2020年1 月21日	2.03	630,000.0 0	1,278,900 .00
20191218 00000503	601928	凤凰传媒	2019年 12月18日	2020年1 月2日	7.61	13,100.00	99,691.00
20191219 00000268	601928	凤凰传媒	2019年 12月19日	2020年1 月16日	7.61	41,600.00	316,576.0 0
20191219 00000417	601958	金铝股份	2019年 12月19日	2020年1 月16日	8.01	51,600.00	413,316.0 0
20191217 00000329	601966	玲珑轮胎	2019年 12月17日	2020年1 月14日	22.93	24,500.00	561,785.0 0
20191212 00000166	601969	海南矿业	2019年 12月12日	2020年1 月9日	5.79	110,000.0 0	636,900.0 0
20191217 00000316	601969	海南矿业	2019年 12月17日	2020年1 月14日	5.79	176,000.0 0	1,019,040 .00
20191217	601969	海南矿业	2019年	2020年1	5.79	20,700.00	119,853.0

00000321			12月17日	月14日			0
20191218 00000650	601975	招商南油	2019年 12月18日	2020年1 月2日	2.81	34,400.00	96,664.00
20191218 00000438	601975	招商南油	2019年 12月18日	2020年1 月15日	2.81	350,000.0 0	983,500.0 0
20191218 00000442	601975	招商南油	2019年 12月18日	2020年1 月15日	2.81	107,600.0 0	302,356.0 0
20191204 00000276	603000	人民网	2019年 12月4日	2020年1 月2日	19.79	190,000.0 0	3,760,100 .00
20191205 00000394	603000	人民网	2019年 12月5日	2020年1 月2日	19.79	150,000.0 0	2,968,500 .00
20191211 00000405	603000	人民网	2019年 12月11日	2020年1 月8日	19.79	240,000.0 0	4,749,600 .00
20191212 00000194	603000	人民网	2019年 12月12日	2020年1 月9日	19.79	60,000.00	1,187,400 .00
20191217 00000498	603000	人民网	2019年 12月17日	2020年1 月14日	19.79	49,000.00	969,710.0 0
20191217 00000506	603000	人民网	2019年 12月17日	2020年1 月14日	19.79	40,000.00	791,600.0 0
20191218 00000490	603000	人民网	2019年 12月18日	2020年1 月2日	19.79	14,000.00	277,060.0 0
20191218 00000651	603000	人民网	2019年 12月18日	2020年1 月15日	19.79	30,000.00	593,700.0 0
20191219 00000387	603000	人民网	2019年 12月19日	2020年1 月16日	19.79	150,000.0 0	2,968,500 .00
20191219 00000392	603000	人民网	2019年 12月19日	2020年1 月16日	19.79	40,000.00	791,600.0 0
20191220 00000192	603000	人民网	2019年 12月20日	2020年1 月3日	19.79	14,100.00	279,039.0 0
20191220 00000212	603000	人民网	2019年 12月20日	2020年1 月17日	19.79	55,900.00	1,106,261 .00

			日				
20191224 00000226	603025	大豪科技	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 21 日	9.47	10,000.00	94,700.00
20191212 00000145	603077	和邦生物	2019 年 12 月 12 日	2020 年 1 月 9 日	1.48	300,000.0 0	444,000.0 0
20191218 00000434	603077	和邦生物	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 15 日	1.48	296,100.0 0	438,228.0 0
20191210 00000530	603198	迎驾贡酒	2019 年 12 月 10 日	2020 年 1 月 7 日	19.92	49,000.00	976,080.0 0
20191211 00000340	603198	迎驾贡酒	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 8 日	19.92	49,000.00	976,080.0 0
20191219 00000281	603198	迎驾贡酒	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	19.92	13,400.00	266,928.0 0
20191219 00000349	603228	景旺电子	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	43.82	10,000.00	438,200.0 0
20191217 00000478	603233	大参林	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	52.25	50,000.00	2,612,500 .00
20191217 00000480	603233	大参林	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	52.25	10,000.00	522,500.0 0
20191223 00000362	603233	大参林	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	52.25	110,000.0 0	5,747,500 .00
20191217 00000425	603328	依顿电子	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 14 日	11.32	20,200.00	228,664.0 0
20191227 00000468	603328	依顿电子	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 10 日	11.32	28,000.00	316,960.0 0
20191219 00000264	603338	浙江鼎力	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	71.50	10,000.00	715,000.0 0
20191223 00000295	603338	浙江鼎力	2019 年 12 月 23 日	2020 年 1 月 20 日	71.50	13,000.00	929,500.0 0
20191209	603355	莱克电气	2019 年	2020 年 1	23.67	40,000.00	946,800.0

00000477			12月9日	月6日			0
20191220 00000186	603355	莱克电气	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	23.67	10,000.00	236,700.0 0
20191206 00000268	603377	东方时尚	2019年 12月6日	2020年1 月3日	18.26	60,000.00	1,095,600 .00
20191209 00000427	603377	东方时尚	2019年 12月9日	2020年1 月6日	18.26	150,000.0 0	2,739,000 .00
20191212 00000167	603377	东方时尚	2019年 12月12 日	2020年1 月9日	18.26	10,000.00	182,600.0 0
20191219 00000344	603377	东方时尚	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	18.26	13,400.00	244,684.0 0
20191224 00000250	603377	东方时尚	2019年 12月24 日	2020年1 月21日	18.26	30,000.00	547,800.0 0
20191220 00000163	603379	三美股份	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	37.35	10,000.00	373,500.0 0
20191223 00000277	603379	三美股份	2019年 12月23 日	2020年1 月20日	37.35	14,300.00	534,105.0 0
20191227 00000515	603379	三美股份	2019年 12月27 日	2020年1 月10日	37.35	28,000.00	1,045,800 .00
20191205 00000296	603444	吉比特	2019年 12月5日	2020年1 月2日	298.49	10,000.00	2,984,900 .00
20191211 00000342	603444	吉比特	2019年 12月11 日	2020年1 月8日	298.49	10,000.00	2,984,900 .00
20191219 00000288	603444	吉比特	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	298.49	10,000.00	2,984,900 .00
20191220 00000168	603444	吉比特	2019年 12月20 日	2020年1 月17日	298.49	10,000.00	2,984,900 .00
20191226 00000226	603444	吉比特	2019年 12月26 日	2020年1 月9日	298.49	10,000.00	2,984,900 .00
20191219 00000283	603515	欧普照明	2019年 12月19 日	2020年1 月16日	28.11	10,000.00	281,100.0 0
20191219	603517	绝味食品	2019年	2020年1	46.45	80,000.00	3,716,000

00000436			12月19日	月16日			.00
20191219 00000438	603517	绝味食品	2019年 12月19日	2020年1 月16日	46.45	16,900.00	785,005.0 0
20191225 00000223	603517	绝味食品	2019年 12月25日	2020年1 月22日	46.45	46,000.00	2,136,700 .00
20191212 00000169	603568	伟明环保	2019年 12月12日	2020年1 月9日	22.94	20,000.00	458,800.0 0
20191213 00000129	603568	伟明环保	2019年 12月13日	2020年1 月10日	22.94	100,000.0 0	2,294,000 .00
20191217 00000383	603568	伟明环保	2019年 12月17日	2020年1 月14日	22.94	10,100.00	231,694.0 0
20191219 00000326	603568	伟明环保	2019年 12月19日	2020年1 月16日	22.94	140,000.0 0	3,211,600 .00
20191225 00000186	603568	伟明环保	2019年 12月25日	2020年1 月22日	22.94	45,000.00	1,032,300 .00
20191206 00000300	603659	璞泰来	2019年 12月6日	2020年1 月3日	85.15	14,000.00	1,192,100 .00
20191217 00000429	603659	璞泰来	2019年 12月17日	2020年1 月14日	85.15	10,000.00	851,500.0 0
20191219 00000390	603659	璞泰来	2019年 12月19日	2020年1 月16日	85.15	10,000.00	851,500.0 0
20191217 00000294	603707	健友股份	2019年 12月17日	2020年1 月14日	41.48	10,600.00	439,688.0 0
20191217 00000423	603712	七一二	2019年 12月17日	2020年1 月14日	24.18	12,000.00	290,160.0 0
20191218 00000632	603766	隆鑫通用	2019年 12月18日	2020年1 月15日	3.73	54,900.00	204,777.0 0
20191219 00000331	603806	福斯特	2019年 12月19日	2020年1 月16日	48.60	10,000.00	486,000.0 0
20191206	603816	顾家家居	2019年	2020年1	45.73	25,000.00	1,143,250

00000217			12月6日	月3日			.00
20191219 00000274	603816	顾家家居	2019年 12月19日	2020年1 月16日	45.73	10,000.00	457,300.0 0
20191217 00000422	603858	步长制药	2019年 12月17日	2020年1 月14日	20.62	32,300.00	666,026.0 0
20191226 00000215	603858	步长制药	2019年 12月26日	2020年1 月9日	20.62	24,300.00	501,066.0 0
20191217 00000430	603866	桃李面包	2019年 12月17日	2020年1 月14日	42.44	10,500.00	445,620.0 0
20191227 00000432	603866	桃李面包	2019年 12月27日	2020年1 月10日	42.44	10,000.00	424,400.0 0
20191220 00000198	603868	飞科电器	2019年 12月20日	2020年1 月17日	37.68	10,000.00	376,800.0 0
20191219 00000269	603882	金域医学	2019年 12月19日	2020年1 月16日	51.22	10,000.00	512,200.0 0
20191219 00000424	603883	老百姓	2019年 12月19日	2020年1 月16日	64.08	10,000.00	640,800.0 0
20191217 00000301	603885	吉祥航空	2019年 12月17日	2020年1 月14日	15.00	34,700.00	520,500.0 0
20191204 00000253	603888	新华网	2019年 12月4日	2020年1 月2日	21.10	20,000.00	422,000.0 0
20191205 00000374	603888	新华网	2019年 12月5日	2020年1 月2日	21.10	99,000.00	2,088,900 .00
20191212 00000158	603888	新华网	2019年 12月12日	2020年1 月9日	21.10	10,000.00	211,000.0 0
20191217 00000421	603888	新华网	2019年 12月17日	2020年1 月14日	21.10	10,700.00	225,770.0 0
20191220 00000173	603888	新华网	2019年 12月20日	2020年1 月17日	21.10	30,000.00	633,000.0 0
20191224 00000268	603888	新华网	2019年 12月24日	2020年1 月21日	21.10	10,000.00	211,000.0 0

20191219 00000437	603939	益丰药房	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 16 日	73.22	10,000.00	732,200.0 0
合计	-	-	-	-	-	165,562,0 00.00	1,480,950 ,793.00

注：根据 2019 年 12 月 31 日发布的《北京首航艾启威节能技术股份有限公司关于变更公司名称暨完成工商变更登记的公告》及 2020 年 1 月 2 日发布的《首航高科能源技术股份有限公司关于变更公司证券简称的公告》，北京首航艾启威节能技术股份有限公司公司名称自 2019 年 12 月 31 日起变更为“首航高科能源技术股份有限公司”，公司证券简称自 2020 年 1 月 3 日起由“首航节能”变更为“首航高科”。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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 500 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 500 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。

7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行；定期存款存放在具有基金托管资格的上海浦东发展银行股份有限公司以及上海银行股份有限公司，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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 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 0.10% (2018 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

7.4.13.3 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 2019 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 2.24%。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,220,969,15 9.36	-	-	-	1,220,969,15 9.36
结算备付金	505,851,292. 36	-	-	-	505,851,292. 36
存出保证金	8,020,574.28	-	-	238,194,364. 80	246,214,939. 08
交易性金融 资产	-	-	44,018,200.0 0	42,548,489.2 48.88	42,592,507.4 48.88
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,575,421.86	4,575,421.86
应收股利	-	-	-	170,122.96	170,122.96
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	26,751,157.1 9	26,751,157.1 9
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,734,841,02 6.00	-	44,018,200.0 0	42,818,180,3 15.69	44,597,039,5 41.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	18,632,676.3 5	18,632,676.3 5
应付托管费	-	-	-	3,726,535.27	3,726,535.27
应付证券清 算款	-	-	-	6,352,253.67	6,352,253.67
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	1,448,171.90	1,448,171.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,630,919.70	1,630,919.70
其他负债	-	-	-	25,579,811.12	25,579,811.12
负债总计	-	-	-	57,370,368.0 1	57,370,368.0 1
利率敏感度 缺口	1,734,841,02 6.00	-	44,018,200.0 0	42,760,809,9 47.68	44,539,669,1 73.68
上年度末 2018 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	96,648,049.93	-	-	-	96,648,049.93
结算备付金	1,169,480,366.88	-	-	-	1,169,480,366.88
存出保证金	10,057,842.29	-	-	234,168,372.00	244,226,214.29
交易性金融资产	-	-	-	31,929,530,734.12	31,929,530,734.12
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收利息	-	-	-	791,397.02	791,397.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,346,139.51	4,346,139.51
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,376,186,259.10	-	-	32,168,836,642.65	33,545,022,901.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	14,655,148.66	14,655,148.66
应付托管费	-	-	-	2,931,029.75	2,931,029.75
应付证券清算款	-	-	-	34,118,506.26	34,118,506.26
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,365,098.60	2,365,098.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	77.08	77.08
其他负债	-	-	-	23,304,911.11	23,304,911.11
负债总计	-	-	-	77,374,771.46	77,374,771.46
利率敏感度缺口	1,376,186,259.10	-	-	32,091,461,871.19	33,467,648,130.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 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 0.10%(2018 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

7.4.13.4.3 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 500 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 500 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 95%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	42,548,489,248.88	95.53	31,929,530,734.12	95.40
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	42,548,489,248.88	95.53	31,929,530,734.12	95.40

注：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。

7.4.13.4.3.2 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(2019年12月31日)	上年度末(2018年12月31日)
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	2,219,189,016.58	1,671,709,024.11
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-2,219,189,016.58	-1,671,709,024.11

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2019 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 56,545,477,355.30 元(2018 年度：41,497,494,628.05 元)，其中包括以股票支付的申购款 25,172,184,478.48 元和以现金支付的申购款 31,373,292,876.82 元(2018 年度：其中包括以股票支付的申购款 17,724,008,114.51 元和以现金支付的申购款 23,773,486,513.54 元)。

(2) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 42,053,115,320.63 元，属于第二层次的余额为 539,392,128.25 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 31,745,855,156.15 元，第二层次 183,151,838.86 元，第三层次 523,739.11 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产	合计		
债券投资	权益工具投资		
2019 年 1 月 1 日	-	523,739.11	523,739.11
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	523,739.11	523,739.11
当期利得或损失总额	-	-	-
——计入损益的利得或损失	-	-	-
2019 年 12 月 31 日	-	-	-
-	-	-	-

2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益

交易性金融资产	合计		
债券投资	权益工具投资		
2018 年 1 月 1 日	-	-	-
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层次	-	523,739.11	523,739.11

转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
——计入损益的利得或损失	-	-	-
2018 年 12 月 31 日	-	523,739.11	523,739.11
-	-11,828,598.39	-11,828,598.39	

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动
——公允价值变动损益

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

2018 年 12 月 31 日

公允价值	估值技术	不可观察输入值	
名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系	
交易性金融资产——股票投资	523,739.11	净资产法	可回收率
30%-50%	正相关		

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	42,548,489,248.88	95.41
	其中：股票	42,548,489,248.88	95.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,018,200.00	0.10
	其中：债券	44,018,200.00	0.10
	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	1,726,820,451.72	3.87
8	其他资产	277,711,641.09	0.62
9	合计	44,597,039,541.69	100.00

1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 1,480,950,793.00 元，占基金资产净值的比例为 3.33%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	286,178,914.12	0.64
B	采矿业	1,376,286,673.83	3.09
C	制造业	24,157,135,681.85	54.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,189,791,264.14	2.67
E	建筑业	554,272,419.70	1.24
F	批发和零售业	1,969,739,103.44	4.42
G	交通运输、仓储和邮政业	1,492,714,012.10	3.35
H	住宿和餐饮业	188,771,008.42	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,308,139,054.14	9.67
J	金融业	2,474,079,968.78	5.55
K	房地产业	1,691,079,691.07	3.80
L	租赁和商务服务业	601,963,146.29	1.35
M	科学研究和技术服务业	251,588,487.14	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	302,826,970.05	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	44,159,710.10	0.10
Q	卫生和社会工作	371,574,700.92	0.83
R	文化、体育和娱乐业	835,085,242.67	1.87
S	综合	439,588,550.76	0.99
	合计	42,534,974,599.52	95.50

8.2.2 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	11,340,012.78	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,987,241.74	0.00
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	154,677.60	0.00
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	1,362.20	0.00
	合计	13,489,872.36	0.03

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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

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	600745	闻泰科技	3,412,138	315,622,765.	0.71

				00	
2	000066	中国长城	17,426,110	271,150,271.60	0.61
3	002463	沪电股份	11,986,120	266,211,725.20	0.60
4	002384	东山精密	11,127,666	255,785,467.90	0.57
5	601099	太平洋	66,299,141	251,273,744.39	0.56
6	601128	常熟银行	27,079,965	246,698,481.15	0.55
7	600584	长电科技	11,100,433	243,987,517.34	0.55
8	300014	亿纬锂能	4,714,121	236,460,309.36	0.53
9	600426	华鲁恒升	11,284,012	224,213,318.44	0.50
10	002049	紫光国微	4,266,147	216,890,913.48	0.49
11	002371	北方华创	2,440,523	214,766,024.00	0.48
12	300383	光环新网	10,669,496	214,136,784.72	0.48
13	002439	启明星辰	6,243,125	211,017,625.00	0.47
14	600201	生物股份	11,243,374	210,475,961.28	0.47
15	600536	中国软件	2,918,264	209,210,346.16	0.47
16	300207	欣旺达	10,697,115	208,807,684.80	0.47
17	002340	格林美	41,066,965	199,996,119.55	0.45
18	601872	招商轮船	24,202,309	199,911,072.34	0.45
19	002465	海格通信	18,243,566	197,577,819.78	0.44
20	600763	通策医疗	1,926,329	197,506,512.37	0.44
21	002812	恩捷股份	3,905,314	197,218,357.00	0.44
22	002129	中环股份	16,546,301	195,411,814.81	0.44

23	300012	华测检测	13,095,882	195,259,600. 62	0.44
24	300253	卫宁健康	13,002,878	194,783,112.4 4	0.44
25	002065	东华软件	18,423,988	190,135,556. 16	0.43
26	300088	长信科技	18,314,337	188,088,240. 99	0.42
27	002127	南极电商	17,017,012	185,655,600. 92	0.42
28	600739	辽宁成大	12,096,649	184,231,964. 27	0.41
29	002273	水晶光电	11,164,636	180,420,517. 76	0.41
30	600801	华新水泥	6,727,293	177,802,353. 99	0.40
31	002821	凯莱英	1,362,418	176,433,131. 00	0.40
32	002353	杰瑞股份	4,721,621	174,511,112.1 6	0.39
33	002180	纳思达	5,230,948	172,202,808. 16	0.39
34	002797	第一创业	20,829,066	170,139,666. 48	0.38
35	300315	掌趣科技	27,295,500	168,413,235. 00	0.38
36	000050	深天马 A	10,120,785	164,867,587. 65	0.37
37	601233	桐昆股份	10,931,154	163,857,998. 46	0.37
38	000988	华工科技	7,987,893	162,074,348. 97	0.36
39	000401	冀东水泥	9,344,182	158,944,535. 82	0.36
40	000009	中国宝安	25,533,050	158,049,579. 50	0.35
41	000750	国海证券	29,218,520	156,026,896. 80	0.35
42	600885	宏发股份	4,451,649	153,359,308. 05	0.34
43	600673	东阳光	14,927,366	152,856,227. 84	0.34
44	000623	吉林敖东	9,212,748	152,286,724. 44	0.34

45	002078	太阳纸业	15,421,905	151,751,545. 20	0.34
46	300285	国瓷材料	6,632,141	151,544,421. 85	0.34
47	002268	卫 士 通	5,819,456	150,083,770. 24	0.34
48	600298	安琪酵母	4,878,686	149,629,299. 62	0.34
49	300529	健帆生物	2,066,452	148,453,911.6 8	0.33
50	600150	中国船舶	6,780,580	147,545,420. 80	0.33
51	002507	涪陵榨菜	5,469,777	146,207,139. 21	0.33
52	002195	二三四五	46,300,637	145,971,057. 51	0.33
53	600161	天坛生物	5,167,459	144,378,804. 46	0.32
54	002926	华西证券	12,998,776	143,116,523.7 6	0.32
55	600642	申能股份	24,337,163	141,398,917. 03	0.32
56	600699	均胜电子	7,858,136	140,660,634. 40	0.32
57	002500	山西证券	16,818,021	139,421,394. 09	0.31
58	603517	绝味食品	2,994,801	139,108,506. 45	0.31
59	002131	利欧股份	46,087,515	136,879,919. 55	0.31
60	600909	华安证券	18,904,025	136,494,382. 50	0.31
61	000975	银泰黄金	9,985,214	135,898,762. 54	0.31
62	300296	利 亚 德	17,582,926	134,861,042. 42	0.30
63	300168	万达信息	8,699,114	134,227,329. 02	0.30
64	000998	隆平高科	9,123,336	134,204,272. 56	0.30
65	600256	广汇能源	40,233,570	133,173,116.7 0	0.30
66	002572	索 菲 亚	6,352,745	133,090,007. 75	0.30

67	002373	千方科技	7,360,216	132,778,296. 64	0.30
68	603444	吉比特	443,072	132,252,561. 28	0.30
69	601100	恒立液压	2,642,604	131,469,549. 00	0.30
70	600704	物产中大	25,020,514	131,357,698. 50	0.29
71	600325	华发股份	16,775,906	131,355,343. 98	0.29
72	600879	航天电子	21,708,626	129,817,583. 48	0.29
73	600143	金发科技	17,830,818	129,808,355. 04	0.29
74	000686	东北证券	13,940,680	129,648,324. 00	0.29
75	601231	环旭电子	6,726,818	129,356,710. 14	0.29
76	002387	维信诺	8,189,711	128,173,404. 90	0.29
77	601799	星宇股份	1,347,383	127,974,437. 34	0.29
78	600079	人福医药	9,391,492	126,879,056. 92	0.28
79	600528	中铁工业	10,996,674	126,461,751. 00	0.28
80	600486	扬农化工	1,841,469	126,380,017. 47	0.28
81	002385	大北农	25,229,421	125,642,516. 58	0.28
82	002250	联化科技	7,318,185	125,360,509. 05	0.28
83	601168	西部矿业	18,895,688	125,089,454. 56	0.28
84	600132	重庆啤酒	2,403,914	124,907,371. 44	0.28
85	600728	佳都科技	13,195,317	123,772,073. 46	0.28
86	002013	中航机电	17,789,766	123,460,976. 04	0.28
87	000513	丽珠集团	3,652,705	123,096,158. 50	0.28
88	000999	华润三九	3,883,079	123,015,942. 72	0.28

89	600446	金证股份	5,958,570	122,627,370. 60	0.28
90	002670	国盛金控	9,581,152	121,776,441. 92	0.27
91	002223	鱼跃医疗	5,967,433	121,258,238. 56	0.27
92	600460	士 兰 微	7,808,563	120,798,469. 61	0.27
93	002019	亿帆医药	7,421,476	120,598,985. 00	0.27
94	002281	光迅科技	4,032,874	120,098,987. 72	0.27
95	600567	山鹰纸业	31,792,146	119,856,390.4 2	0.27
96	002174	游族网络	5,270,735	119,330,303.8 5	0.27
97	600895	张江高科	7,676,917	117,533,599.2 7	0.26
98	603858	步长制药	5,631,603	116,123,653.8 6	0.26
99	000778	新兴铸管	27,672,301	115,393,495.1 7	0.26
100	002152	广电运通	11,955,418	114,891,566.9 8	0.26
101	000997	新 大 陆	7,233,783	114,872,474.0 4	0.26
102	002074	国轩高科	7,892,036	114,829,123.8 0	0.26
103	000878	云南铜业	8,392,889	114,646,863.7 4	0.26
104	000547	航天发展	11,159,980	114,054,995.6 0	0.26
105	300418	昆仑万维	6,797,290	113,854,607.5 0	0.26
106	600572	康 恩 贝	18,490,673	113,717,638.9 5	0.26
107	002110	三钢闽光	12,096,441	113,222,687.7 6	0.25
108	600820	隧道股份	18,697,304	112,931,716.1 6	0.25
109	600521	华海药业	6,524,379	112,610,781.5 4	0.25
110	600410	华胜天成	10,877,951	112,151,674.8 1	0.25

111	600273	嘉化能源	9,912,710	111,517,987.5 0	0.25
112	300308	中际旭创	2,125,495	110,844,564.2 5	0.25
113	002092	中泰化学	16,322,914	110,832,586.0 6	0.25
114	000581	威孚高科	5,806,475	110,613,348.7 5	0.25
115	603659	璞泰来	1,297,584	110,489,277.6 0	0.25
116	600497	驰宏锌锗	25,189,702	110,330,894.7 6	0.25
117	600466	蓝光发展	14,909,350	109,881,909. 50	0.25
118	600845	宝信软件	3,329,311	109,534,331. 90	0.25
119	603939	益丰药房	1,494,489	109,426,484. 58	0.25
120	603000	人民网	5,523,972	109,319,405. 88	0.25
121	002075	沙钢股份	17,514,703	109,116,599.6 9	0.24
122	002212	南洋股份	5,736,355	109,048,108. 55	0.24
123	600549	厦门钨业	8,358,962	109,000,864. 48	0.24
124	601966	玲珑轮胎	4,731,867	108,501,710. 31	0.24
125	601005	重庆钢铁	58,146,466	107,570,962. 10	0.24
126	000830	鲁西化工	10,187,698	107,072,705. 98	0.24
127	300058	蓝色光标	18,928,802	106,947,731. 30	0.24
128	300274	阳光电源	10,130,304	106,672,101. 12	0.24
129	000060	中金岭南	24,772,817	106,523,113.1 0	0.24
130	600839	四川长虹	36,568,606	106,414,643. 46	0.24
131	300113	顺网科技	4,139,040	106,331,937. 60	0.24
132	002690	美亚光电	2,706,426	105,821,256. 60	0.24

133	000636	风华高科	7,084,132	105,482,725. 48	0.24
134	600884	杉杉股份	7,787,838	105,213,691. 38	0.24
135	300166	东方国信	8,045,270	104,588,510. 00	0.23
136	600415	小商品城	26,880,421	104,027,229. 27	0.23
137	000960	锡业股份	9,939,292	103,766,208. 48	0.23
138	000039	中集集团	10,539,477	103,497,664. 14	0.23
139	600260	凯乐科技	7,609,981	103,267,442. 17	0.23
140	601333	广深铁路	33,610,805	102,849,063. 30	0.23
141	600881	亚泰集团	32,234,032	102,826,562. 08	0.23
142	002217	合力泰	18,517,053	102,769,644. 15	0.23
143	600315	上海家化	3,313,673	102,525,042. 62	0.23
144	600258	首旅酒店	4,960,754	102,241,139. 94	0.23
145	300251	光线传媒	8,656,524	102,146,983. 20	0.23
146	600779	水井坊	1,970,692	101,983,311.0 0	0.23
147	300001	特锐德	5,935,400	101,970,172. 00	0.23
148	601866	中远海发	39,300,222	101,787,574. 98	0.23
149	600376	首开股份	12,769,329	101,771,552. 13	0.23
150	600021	上海电力	12,567,674	101,169,775. 70	0.23
151	300316	晶盛机电	6,387,607	100,413,182. 04	0.23
152	600959	江苏有线	25,213,760	100,350,764. 80	0.23
153	600875	东方电气	10,890,159	100,080,561. 21	0.22
154	000089	深圳机场	10,187,200	99,528,944.0 0	0.22

155	600380	健康元	9,608,290	99,445,801.50	0.22
156	002191	劲嘉股份	8,688,059	99,130,753.19	0.22
157	600160	巨化股份	13,614,542	99,113,865.76	0.22
158	600811	东方集团	29,425,873	98,870,933.28	0.22
159	600718	东软集团	8,595,141	97,554,850.35	0.22
160	000690	宝新能源	17,259,512	97,516,242.80	0.22
161	600776	东方通信	4,678,788	97,459,154.04	0.22
162	002807	江阴银行	20,798,503	96,921,023.98	0.22
163	603338	浙江鼎力	1,354,227	96,827,230.50	0.22
164	600155	华创阳安	6,864,504	96,308,991.12	0.22
165	300115	长盈精密	5,404,713	96,149,844.27	0.22
166	002368	太极股份	2,468,915	96,090,171.80	0.22
167	000983	西山煤电	15,629,700	95,810,061.00	0.22
168	600755	厦门国贸	13,017,315	95,547,092.10	0.21
169	600166	福田汽车	45,596,536	95,296,760.24	0.21
170	300009	安科生物	6,266,063	94,554,890.67	0.21
171	600392	盛和资源	10,410,331	94,421,702.17	0.21
172	600580	卧龙电驱	7,850,645	94,364,752.90	0.21
173	600022	山东钢铁	65,068,930	93,048,569.90	0.21
174	600643	爱建集团	9,649,551	92,635,689.60	0.21
175	600094	大名城	15,818,850	92,540,272.50	0.21
176	603882	金城医学	1,805,745	92,490,258.90	0.21

177	000825	太钢不锈	22,503,748	92,040,329.3 2	0.21
178	002589	瑞康医药	11,947,450	91,875,890.5 0	0.21
179	000402	金 融 街	11,266,233	91,481,811.96	0.21
180	600373	中文传媒	6,690,979	91,064,224.1 9	0.20
181	000729	燕京啤酒	13,958,475	91,009,257.0 0	0.20
182	002085	万丰奥威	12,995,477	90,968,339.0 0	0.20
183	600282	南钢股份	26,329,779	90,837,737.5 5	0.20
184	600808	马钢股份	29,557,249	90,740,754.4 3	0.20
185	600266	城建发展	11,174,183	90,510,882.3 0	0.20
186	000970	中科三环	8,415,997	90,471,967.7 5	0.20
187	300027	华谊兄弟	19,408,811	89,862,794.9 3	0.20
188	603885	吉祥航空	5,969,812	89,547,180.0 0	0.20
189	600737	中粮糖业	10,578,274	89,492,198.0 4	0.20
190	600026	中远海能	13,998,505	89,310,461.9 0	0.20
191	600167	联美控股	6,781,926	89,250,146.1 6	0.20
192	002233	塔牌集团	7,076,173	89,159,779.8 0	0.20
193	600216	浙江医药	6,671,308	89,061,961.8 0	0.20
194	600967	内蒙一机	8,372,814	89,003,012.8 2	0.20
195	002221	东华能源	11,447,132	88,829,744.3 2	0.20
196	000021	深 科 技	7,282,770	88,704,138.6 0	0.20
197	300010	立 思 辰	6,864,882	88,625,626.6 2	0.20
198	603707	健友股份	2,134,734	88,548,766.3 2	0.20

199	002407	多氟多	6,745,968	88,439,640.48	0.20
200	600171	上海贝岭	5,578,156	87,855,957.00	0.20
201	600037	歌华有线	9,659,340	87,030,653.40	0.20
202	000563	陕国投 A	19,609,286	86,869,136.98	0.20
203	600804	鹏博士	14,172,791	86,737,480.92	0.19
204	600754	锦江酒店	3,040,288	86,529,868.48	0.19
205	601699	潞安环能	11,878,887	86,240,719.62	0.19
206	600435	北方导航	10,302,507	85,716,858.24	0.19
207	601098	中南传媒	7,105,091	84,834,786.54	0.19
208	600777	新潮能源	40,370,000	84,777,000.00	0.19
209	600060	海信视像	7,786,853	84,487,355.05	0.19
210	002317	众生药业	6,618,485	84,054,759.50	0.19
211	002372	伟星新材	6,377,831	83,996,034.27	0.19
212	000031	大悦城	11,688,092	83,920,500.56	0.19
213	601118	海南橡胶	16,969,895	83,491,883.40	0.19
214	600064	南京高科	8,551,202	83,374,219.50	0.19
215	603866	桃李面包	1,959,300	83,152,692.00	0.19
216	000598	兴蓉环境	17,718,140	82,034,988.20	0.18
217	603816	顾家家居	1,787,257	81,731,262.61	0.18
218	300244	迪安诊断	3,686,305	81,577,929.65	0.18
219	600782	新钢股份	15,823,413	81,174,108.69	0.18
220	600511	国药股份	2,968,833	81,019,452.57	0.18

221	600640	号百控股	3,138,167	80,996,090.27	0.18
222	000883	湖北能源	19,363,889	80,747,417.13	0.18
223	002038	双鹭药业	6,121,847	80,502,288.05	0.18
224	603228	景旺电子	1,825,593	79,997,485.26	0.18
225	000932	华菱钢铁	16,729,416	79,966,608.48	0.18
226	000807	云铝股份	15,513,230	79,738,002.20	0.18
227	600409	三友化工	12,599,000	79,625,680.00	0.18
228	600863	内蒙华电	28,798,276	79,195,259.00	0.18
229	002004	华邦健康	16,026,765	79,172,219.10	0.18
230	601106	中国一重	27,149,900	79,006,209.00	0.18
231	002028	思源电气	5,735,553	78,978,564.81	0.18
232	601000	唐山港	29,963,011	77,903,828.60	0.17
233	603077	和邦生物	52,512,823	77,718,978.04	0.17
234	002242	九阳股份	3,083,582	77,582,923.12	0.17
235	002936	郑州银行	16,674,298	77,535,485.70	0.17
236	600597	光明乳业	6,078,893	77,141,152.17	0.17
237	300133	华策影视	10,417,305	77,088,057.00	0.17
238	601958	金钼股份	9,593,679	76,845,368.79	0.17
239	002583	海能达	9,105,370	76,576,161.70	0.17
240	002440	闰土股份	6,820,400	76,388,480.00	0.17
241	002414	高德红外	3,708,947	76,333,887.00	0.17
242	000877	天山股份	6,438,890	76,300,846.50	0.17

243	002064	华峰氨纶	12,143,666	75,897,912.5 0	0.17
244	603806	福 斯 特	1,537,183	74,707,093.8 0	0.17
245	000027	深圳能源	12,021,846	74,655,663.6 6	0.17
246	600970	中材国际	10,692,229	74,524,836.1 3	0.17
247	000738	航发控制	5,675,262	74,175,674.3 4	0.17
248	600008	首创股份	22,537,224	74,147,466.9 6	0.17
249	601179	中国西电	20,308,695	73,923,649.8 0	0.17
250	600138	中 青 旅	5,865,419	73,904,279.4 0	0.17
251	002048	宁波华翔	4,765,550	73,675,403.0 0	0.17
252	603883	老 百 姓	1,144,810	73,359,424.8 0	0.16
253	000559	万向钱潮	13,656,510	73,335,458.7 0	0.16
254	300072	三聚环保	11,598,145	73,300,276.4 0	0.16
255	601689	拓普集团	4,192,587	73,076,791.4 1	0.16
256	600500	中化国际	13,745,175	72,849,427.5 0	0.16
257	600827	百联股份	8,110,808	72,835,055.8 4	0.16
258	000930	中粮科技	11,021,423	72,741,391.8 0	0.16
259	600729	重庆百货	2,431,713	72,586,633.0 5	0.16
260	000528	柳 工	10,457,136	72,572,523.8 4	0.16
261	002399	海 普 瑞	3,704,999	72,284,530.4 9	0.16
262	600388	龙净环保	7,412,159	72,268,550.2 5	0.16
263	000685	中山公用	8,750,388	72,103,197.1 2	0.16
264	600039	四川路桥	21,458,683	72,101,174.8 8	0.16

265	600507	方大特钢	7,162,882	72,058,592.9 2	0.16
266	000008	神州高铁	19,756,832	71,717,300.1 6	0.16
267	600649	城投控股	12,514,256	71,581,544.3 2	0.16
268	600515	海航基础	15,901,820	70,922,117.20	0.16
269	600633	浙数文化	7,747,824	70,892,589.6 0	0.16
270	601718	际华集团	21,735,185	70,856,703.1 0	0.16
271	600056	中国医药	5,394,454	70,397,624.7 0	0.16
272	300180	华峰超纤	7,956,828	70,338,359.5 2	0.16
273	002831	裕同科技	2,627,418	69,757,947.9 0	0.16
274	000712	锦龙股份	4,556,888	69,264,697.6 0	0.16
275	000028	国药一致	1,524,959	69,172,140.2 4	0.16
276	000488	晨鸣纸业	13,558,850	69,014,546.5 0	0.15
277	600062	华润双鹤	5,283,468	68,949,257.4 0	0.15
278	600120	浙江东方	7,895,766	68,930,037.1 8	0.15
279	601717	郑煤机	10,653,343	68,927,129.2 1	0.15
280	601228	广州港	17,975,060	68,844,479.8 0	0.15
281	000090	天健集团	12,949,711	68,633,468.3 0	0.15
282	600598	北大荒	7,031,084	68,482,758.1 6	0.15
283	600158	中体产业	6,826,456	68,469,353.6 8	0.15
284	002056	横店东磁	8,341,516	68,400,431.2 0	0.15
285	300182	捷成股份	19,501,648	68,060,751.5 2	0.15
286	300026	红日药业	19,274,301	67,652,796.5 1	0.15

287	600348	阳泉煤业	12,222,115	67,588,295.9 5	0.15
288	002155	湖南黄金	8,554,400	67,494,216.0 0	0.15
289	000887	中鼎股份	7,452,929	67,449,007.4 5	0.15
290	600823	世茂股份	14,861,432	66,876,444.0 0	0.15
291	600908	无锡银行	11,999,532	66,597,402.6 0	0.15
292	000158	常山北明	9,752,405	66,511,402.10	0.15
293	000400	许继电气	6,173,481	66,488,390.3 7	0.15
294	000012	南 玻 A	13,258,529	66,425,230.2 9	0.15
295	601598	中国外运	15,591,047	66,417,860.2 2	0.15
296	600648	外 高 桥	3,800,526	66,015,136.6 2	0.15
297	600418	江淮汽车	13,132,799	65,926,650.9 8	0.15
298	002002	鸿达兴业	15,788,904	65,681,840.6 4	0.15
299	601608	中信重工	17,616,932	65,534,987.0 4	0.15
300	600307	酒钢宏兴	31,682,991	65,266,961.4 6	0.15
301	002030	达安基因	5,663,317	65,128,145.5 0	0.15
302	600563	法拉电子	1,314,931	65,023,337.9 5	0.15
303	000826	启迪环境	7,076,230	64,959,791.4 0	0.15
304	600277	亿利洁能	14,242,910	64,947,669.6 0	0.15
305	002266	浙富控股	15,703,619	64,698,910.2 8	0.15
306	002408	齐翔腾达	9,001,387	64,359,917.0 5	0.14
307	600717	天 津 港	10,200,546	64,059,428.8 8	0.14
308	601880	大 连 港	31,492,233	63,929,232.9 9	0.14

309	000301	东方盛虹	12,317,387	63,804,064.6 6	0.14
310	002183	怡亚通	15,100,419	63,572,763.9 9	0.14
311	002701	奥瑞金	14,411,340	63,554,009.4 0	0.14
312	002665	首航高科	18,818,955	63,231,688.8 0	0.14
313	000156	华数传媒	5,977,118	62,401,111.92	0.14
314	600862	中航高科	5,654,513	62,312,733.2 6	0.14
315	000681	视觉中国	3,610,148	62,238,951.5 2	0.14
316	000732	泰禾集团	10,103,282	62,135,184.3 0	0.14
317	002640	跨境通	8,035,958	62,037,595.7 6	0.14
318	000758	中色股份	13,997,568	61,309,347.8 4	0.14
319	000078	海王生物	16,411,575	61,215,174.7 5	0.14
320	600557	康缘药业	4,121,553	60,751,691.2 2	0.14
321	002244	滨江集团	12,317,354	60,601,381.6 8	0.14
322	002815	崇达技术	3,489,203	60,328,319.8 7	0.14
323	300134	大富科技	3,906,615	60,240,003.3 0	0.14
324	002280	联络互动	15,370,500	59,483,835.0 0	0.13
325	601928	凤凰传媒	7,777,048	59,183,335.2 8	0.13
326	002302	西部建设	5,227,170	59,014,749.3 0	0.13
327	002603	以岭药业	4,746,831	59,003,109.3 3	0.13
328	300002	神州泰岳	18,094,208	58,987,118.08	0.13
329	000718	苏宁环球	15,428,800	58,938,016.0 0	0.13
330	002925	盈趣科技	1,339,172	58,856,609.4 0	0.13
331	600901	江苏租赁	9,307,993	58,826,515.7	0.13

				6	
332	002426	胜利精密	24,909,001	58,785,242.3 6	0.13
333	002444	巨星科技	5,450,688	58,540,389.1 2	0.13
334	000717	韶钢松山	12,290,100	58,255,074.0 0	0.13
335	600664	哈药股份	15,353,737	58,190,663.2 3	0.13
336	002635	安洁科技	3,490,053	58,179,183.5 1	0.13
337	000727	华东科技	27,644,000	57,775,960.0 0	0.13
338	603712	七一二	2,380,900	57,570,162.0 0	0.13
339	002709	天赐材料	2,776,980	57,483,486.0 0	0.13
340	601611	中国核建	8,049,717	57,394,482.2 1	0.13
341	300324	旋极信息	10,594,093	57,376,920.8 0	0.13
342	600316	洪都航空	4,402,905	57,369,852.1 5	0.13
343	000813	德展健康	9,098,027	57,226,589.8 3	0.13
344	000959	首钢股份	16,173,251	57,091,576.0 3	0.13
345	002390	信邦制药	10,869,566	57,065,221.5 0	0.13
346	600499	科达洁能	13,121,470	56,815,965.1 0	0.13
347	600748	上实发展	9,532,433	56,622,652.0 2	0.13
348	600645	中源协和	3,327,164	56,328,886.5 2	0.13
349	601678	滨化股份	10,973,366	56,073,900.2 6	0.13
350	600339	中油工程	16,521,334	56,007,322.2 6	0.13
351	002839	张家港行	9,393,200	55,795,608.0 0	0.13
352	601975	招商南油	19,795,143	55,624,351.8 3	0.12

353	600125	铁龙物流	9,284,824	55,523,247.5 2	0.12
354	002203	海亮股份	5,405,184	55,403,136.0 0	0.12
355	600859	王府井	3,953,920	55,315,340.8 0	0.12
356	000501	鄂武商 A	4,163,890	55,296,459.2 0	0.12
357	600765	中航重机	5,389,248	55,132,007.0 4	0.12
358	600835	上海机电	3,322,354	55,051,405.7 8	0.12
359	000519	中兵红箭	7,222,276	55,033,743.1 2	0.12
360	000967	盈峰环境	8,901,617	54,922,976.8 9	0.12
361	600195	中牧股份	4,748,728	54,847,808.4 0	0.12
362	600291	西水股份	6,099,353	54,833,183.4 7	0.12
363	600017	日照港	18,758,122	54,586,135.0 2	0.12
364	600312	平高电气	8,446,216	54,562,555.3 6	0.12
365	603233	大参林	1,039,786	54,328,818.5 0	0.12
366	600073	上海梅林	6,782,577	54,057,138.6 9	0.12
367	600582	天地科技	16,917,697	53,967,453.4 3	0.12
368	600259	广晟有色	1,543,523	53,668,294.7 1	0.12
369	000543	皖能电力	11,557,336	53,626,039.0 4	0.12
370	600565	迪马股份	14,940,200	53,485,916.0 0	0.12
371	600141	兴发集团	5,201,318	53,469,549.0 4	0.12
372	000987	越秀金控	5,444,005	52,643,528.3 5	0.12
373	600545	卓郎智能	8,717,506	52,607,578.4 2	0.12
374	002419	天虹股份	4,966,745	52,399,159.7 5	0.12

375	600751	海航科技	17,820,747	52,214,788.7 1	0.12
376	601200	上海环境	4,702,800	52,201,080.0 0	0.12
377	002491	通鼎互联	7,889,104	52,146,977.4 4	0.12
378	002745	木林森	3,798,728	51,700,688.0 8	0.12
379	600317	营口港	20,266,743	51,680,194.6 5	0.12
380	000006	深振业 A	9,627,354	51,602,617.4 4	0.12
381	002249	大洋电机	13,198,558	50,946,433.8 8	0.11
382	600478	科力远	11,472,700	50,479,880.0 0	0.11
383	002434	万里扬	5,299,900	50,243,052.0 0	0.11
384	002920	德赛西威	1,648,029	49,984,719.5 7	0.11
385	002505	大康农业	28,561,257	49,982,199.7 5	0.11
386	000761	本钢板材	12,662,111	49,888,717.3 4	0.11
387	002051	中工国际	5,102,840	49,599,604.8 0	0.11
388	002128	露天煤业	5,711,728	49,463,564.4 8	0.11
389	600869	智慧能源	10,076,954	49,377,074.6 0	0.11
390	002382	蓝帆医疗	4,066,734	48,549,150.7 6	0.11
391	000848	承德露露	6,134,241	48,276,476.6 7	0.11
392	002544	杰赛科技	3,544,401	48,274,741.6 2	0.11
393	600126	杭钢股份	9,865,820	48,243,859.8 0	0.11
394	002285	世联行	12,719,154	47,696,827.5 0	0.11
395	603198	迎驾贡酒	2,392,464	47,657,882.8 8	0.11
396	002118	紫鑫药业	7,602,282	47,438,239.6 8	0.11

397	600787	中储股份	9,105,041	47,437,263.6 1	0.11
398	601326	秦港股份	14,806,700	47,233,373.0 0	0.11
399	002176	江特电机	12,404,400	46,640,544.0 0	0.10
400	601139	深圳燃气	5,874,158	45,994,657.1 4	0.10
401	600759	洲际油气	16,496,506	45,695,321.6 2	0.10
402	002470	金正大	17,106,795	45,504,074.7 0	0.10
403	000564	供销大集	18,719,101	44,738,651.3 9	0.10
404	603568	伟明环保	1,938,160	44,461,390.4 0	0.10
405	300376	易事特	9,694,500	44,400,810.0 0	0.10
406	603377	东方时尚	2,418,385	44,159,710.1 0	0.10
407	000062	深圳华强	3,090,796	44,012,935.0 4	0.10
408	600770	综艺股份	8,145,778	43,905,743.4 2	0.10
409	601019	山东出版	6,283,600	43,671,020.0 0	0.10
410	603888	新华网	2,062,356	43,515,711.60	0.10
411	603515	欧普照明	1,547,242	43,492,972.6 2	0.10
412	002573	清新环境	6,737,742	43,458,435.9 0	0.10
413	002375	亚厦股份	7,484,985	43,412,913.0 0	0.10
414	002681	奋达科技	8,083,899	43,348,156.4 2	0.10
415	000537	广宇发展	5,534,905	43,006,211.85	0.10
416	300197	铁汉生态	13,994,541	42,823,295.4 6	0.10
417	300297	蓝盾股份	7,428,036	41,894,123.0 4	0.09
418	601016	节能风电	17,342,500	41,795,425.0 0	0.09
419	002093	国脉科技	5,177,613	41,731,560.7	0.09

				8	
420	300159	新研股份	10,619,572	41,628,722.24	0.09
421	600639	浦东金桥	3,064,992	41,377,392.00	0.09
422	002867	周大生	2,169,700	41,311,088.00	0.09
423	600694	大商股份	1,496,787	40,996,995.93	0.09
424	603328	依顿电子	3,653,767	40,745,642.44	0.09
425	002358	森源电气	5,811,848	40,624,817.52	0.09
426	000553	安道麦 A	4,044,584	40,445,840.00	0.09
427	600329	中新药业	2,885,256	39,989,648.16	0.09
428	600575	淮河能源	15,506,200	39,850,934.00	0.09
429	603766	隆鑫通用	10,680,018	39,836,467.14	0.09
430	300459	金科文化	12,414,667	39,602,787.73	0.09
431	000061	农产品	7,017,619	39,228,490.21	0.09
432	600757	长江传媒	6,360,433	39,180,267.28	0.09
433	000426	兴业矿业	7,792,340	38,727,929.80	0.09
434	600623	华谊集团	5,822,259	38,718,022.35	0.09
435	300257	开山股份	3,550,265	38,626,883.20	0.09
436	002503	搜于特	16,075,652	38,420,808.28	0.09
437	000937	冀中能源	10,481,884	38,363,695.44	0.09
438	600985	淮北矿业	3,831,054	38,272,229.46	0.09
439	601001	大同煤业	8,691,887	38,244,302.80	0.09
440	600006	东风汽车	8,312,762	38,072,449.96	0.09
441	000869	张裕 A	1,312,530	37,669,611.00	0.08

442	002625	光启技术	4,266,592	37,617,316.80	0.08
443	002366	台海核电	5,388,794	37,506,006.24	0.08
444	000536	华映科技	13,717,387	37,036,944.90	0.08
445	000990	诚志股份	2,498,700	37,030,734.00	0.08
446	600098	广州发展	5,659,260	37,011,560.40	0.08
447	002424	贵州百灵	4,212,463	36,690,552.73	0.08
448	002672	东江环保	4,047,188	36,424,692.00	0.08
449	000980	众泰汽车	12,429,600	36,418,728.00	0.08
450	000600	建投能源	7,441,566	36,389,257.74	0.08
451	600428	中远海特	9,728,372	36,384,111.28	0.08
452	600058	五矿发展	4,507,701	36,151,762.02	0.08
453	600903	贵州燃气	2,420,660	35,777,354.80	0.08
454	600657	信达地产	8,870,662	35,393,941.38	0.08
455	601615	明阳智能	2,868,930	35,287,839.00	0.08
456	600338	西藏珠峰	2,800,547	35,006,837.50	0.08
457	600350	山东高速	7,096,427	34,843,456.57	0.08
458	601801	皖新传媒	6,342,595	34,757,420.60	0.08
459	000766	通化金马	5,309,677	34,725,287.58	0.08
460	002948	青岛银行	5,753,100	34,173,414.00	0.08
461	603486	科沃斯	1,670,081	33,885,943.49	0.08
462	603556	海兴电力	2,045,090	33,334,967.00	0.07
463	002416	爱施德	4,359,717	33,177,446.37	0.07
464	600053	九鼎投资	1,296,055	32,958,678.6	0.07

				5	
465	600874	创业环保	4,576,952	32,908,284.88	0.07
466	002653	海思科	1,597,981	32,534,893.16	0.07
467	601127	小康股份	2,830,848	32,271,667.20	0.07
468	600707	彩虹股份	7,488,500	31,451,700.00	0.07
469	603056	德邦股份	2,795,239	31,055,105.29	0.07
470	601003	柳钢股份	5,332,000	30,125,800.00	0.07
471	002818	富森美	2,263,008	28,627,051.20	0.06
472	002482	广田集团	6,395,045	28,010,297.10	0.06
473	300199	翰宇药业	4,809,392	27,894,473.60	0.06
474	002437	誉衡药业	9,068,646	27,477,997.38	0.06
475	600335	国机汽车	4,601,360	26,687,888.00	0.06
476	601869	长飞光纤	787,500	26,011,125.00	0.06
477	600996	贵广网络	3,206,600	25,813,130.00	0.06
478	000025	特力A	1,167,224	24,745,148.80	0.06
479	603983	丸美股份	391,231	23,485,596.93	0.05
480	601969	海南矿业	3,982,200	23,056,938.00	0.05
481	601860	紫金银行	3,865,000	21,721,300.00	0.05
482	603225	新凤鸣	1,721,681	21,262,760.35	0.05
483	601811	新华文轩	1,561,451	20,595,538.69	0.05
484	600939	重庆建工	3,918,506	18,848,013.86	0.04
485	601865	福莱特	1,462,211	17,736,619.43	0.04
486	603379	三美股份	474,184	17,710,772.4	0.04

				0	
487	601068	中铝国际	3,158,469	17,497,918.26	0.04
488	603650	彤程新材	1,013,714	17,312,397.88	0.04
489	603355	莱克电气	727,808	17,227,215.36	0.04
490	603317	天味食品	355,169	15,947,088.10	0.04
491	603868	飞科电器	383,497	14,450,166.96	0.03
492	001872	招商港口	839,552	14,406,712.32	0.03
493	600917	重庆燃气	1,937,963	14,069,611.38	0.03
494	603256	宏和科技	921,400	13,609,078.00	0.03
495	002423	中粮资本	1,387,170	13,469,420.70	0.03
496	603025	大豪科技	1,254,900	11,883,903.00	0.03
497	002957	科瑞技术	357,897	11,728,284.69	0.03
498	002941	新疆交建	644,900	11,317,995.00	0.03
499	002946	新乳业	765,000	9,608,400.00	0.02
500	603877	太平鸟	484,272	7,394,833.44	0.02

8.3.2 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	688009	中国通号	1,540,000	10,456,600.00	0.02
2	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.00
3	688019	安集科技	4,378	560,646.68	0.00
4	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.00
5	688369	致远互联	2,970	154,677.60	0.00
6	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.00
7	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
8	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
9	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
10	603995	甬金股份	88	2,390.08	0.00
11	688139	海尔生物	49	1,415.12	0.00
12	601512	中新集团	98	1,362.20	0.00
13	600267	海正药业	80	792.80	0.00

14	601311	骆驼股份	22	206.36	0.00
----	--------	------	----	--------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002405	四维图新	409,375,803.03	1.22
2	002157	正邦科技	365,633,284.14	1.09
3	002195	二三四五	322,245,311.14	0.96
4	000860	顺鑫农业	313,880,292.64	0.94
5	002916	深南电路	307,932,845.84	0.92
6	002384	东山精密	304,853,640.81	0.91
7	002049	紫光国微	278,569,899.07	0.83
8	002797	第一创业	273,288,928.53	0.82
9	300450	先导智能	272,301,842.95	0.81
10	300253	卫宁健康	268,662,827.07	0.80
11	002439	启明星辰	267,580,886.63	0.80
12	300014	亿纬锂能	260,192,929.17	0.78
13	002340	格林美	259,194,117.61	0.77
14	002129	中环股份	256,790,228.77	0.77
15	000623	吉林敖东	256,395,955.51	0.77
16	002465	海格通信	256,038,859.10	0.77
17	000066	中国长城	255,918,865.74	0.76
18	002075	沙钢股份	255,325,070.58	0.76
19	300383	光环新网	254,032,894.43	0.76
20	002463	沪电股份	251,316,768.32	0.75

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。

8.4.2 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	000860	顺鑫农业	592,726,098.05	1.77
2	002916	深南电路	481,995,914.44	1.44
3	300450	先导智能	469,391,547.04	1.40
4	002405	四维图新	437,003,235.09	1.31
5	300347	泰格医药	428,735,562.76	1.28
6	002410	广联达	383,485,896.77	1.15
7	002506	协鑫集成	363,431,967.09	1.09
8	000656	金科股份	348,246,169.89	1.04

9	300146	汤臣倍健	336,215,164.45	1.00
10	002299	圣农发展	333,386,703.12	1.00
11	002157	正邦科技	323,880,291.59	0.97
12	002195	二三四五	318,028,573.96	0.95
13	002049	紫光国微	304,923,523.19	0.91
14	002384	东山精密	299,548,175.58	0.90
15	002463	沪电股份	298,729,189.16	0.89
16	600183	生益科技	298,294,664.70	0.89
17	000066	中国长城	294,069,217.08	0.88
18	000723	美锦能源	288,562,005.50	0.86
19	000596	古井贡酒	281,298,328.29	0.84
20	002129	中环股份	281,043,663.83	0.84

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。

8.4.3 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	45,648,714,660.75
卖出股票收入（成交）总额	43,064,229,607.78

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。

8.5 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）	44,018,200.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,018,200.00	0.10

8.6 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	110063	鹰 19 转债	140,160	14,016,000.00	0.03
2	128086	国轩转债	130,414	13,041,400.00	0.03
3	110065	淮矿转债	50,190	5,019,000.00	0.01
4	123036	先导转债	47,978	4,797,800.00	0.01
5	110064	建工转债	36,870	3,687,000.00	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2001	IC2001	313	329,701,680.00	25,080,626.86	-
IC2003	IC2003	1,580	1,653,185,600.00	127,383,840.00	-
IC2006	IC2006	2	2,065,760.00	183,760.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					152,648,226.86
股指期货投资本期收益 (元)					298,120,425.63
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					267,442,569.61

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	246,214,939.08
2	应收证券清算款	26,751,157.19
3	应收股利	170,122.96
4	应收利息	4,575,421.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	277,711,641.09

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

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	002384	东山精密	44,480,000.00	0.10	大宗交易锁定期
2	000066	中国长城	42,805,560.00	0.10	转融通融出
3	600745	闻泰科技	41,033,000.00	0.09	转融通融出
4	600584	长电科技	20,331,500.00	0.05	转融通融出
5	300014	亿纬锂能	8,391,768.00	0.02	转融通融出
6	002049	紫光国微	8,134,400.00	0.02	转融通融出
7	601128	常熟银行	3,845,331.00	0.01	转融通融出
8	002384	东山精密	1,817,275.00	0.00	转融通融出
9	601099	太平洋	1,422,766.00	0.00	转融通融出
10	600426	华鲁恒升	1,184,252.00	0.00	转融通融出

8.12.5.2 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	688009	中国通号	10,456,600.00	0.02	科创板新股锁定期
2	003816	中国广核	1,987,241.74	0.00	新股锁定期
3	688019	安集科技	560,646.68	0.00	科创板新股锁定期
4	688181	八亿时空	189,377.88	0.00	新股未上市
5	688369	致远互联	154,677.60	0.00	科创板新股锁定期

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资

						基金联接基金(LOF)	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
247,435	31,537.44	3,940,701,418.00	50.50%	1,984,988,824.00	25.44%	1,877,777,002.00	24.06%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	1,728,426,785.00	22.15%
2	兴业财富-兴业银行“现金宝(4号)”-私人银行类人民币理财产品-兴业财富-兴	298,428,855.00	3.82%
3	中国人寿保险股份有限公司传统账户	214,035,181.00	2.74%
4	中国人民财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品-008C-CT001 沪	143,208,580.00	1.84%
5	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	90,838,787.00	1.16%
6	中国人寿保险(集团)公司	81,449,966.00	1.04%
7	中国人寿保险股份有限公司传统账户	65,458,383.00	0.84%
8	GIC PRIVATE LIMITED	64,921,320.00	0.83%
9	中国人民人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	56,663,070.00	0.73%
10	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	38,037,554.00	0.49%
11	中国农业银行股份有限公司-南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)	1,877,777,002.00	24.06%

9.3 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。

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年2月06日)基金份额	1,147,553,216.00
-------------------------	------------------

总额	
本报告期期初基金份额总额	7,499,867,244.00
本报告期基金总申购份额	10,529,600,000.00
减：报告期基金总赎回份额	10,226,000,000.00
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	7,803,467,244.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

11.2 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。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 7 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 170,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华泰证券	3	60,193,489,392.83	68.22%	6,020,203.06	68.22%	-
平安证券	2	21,795,797,601.61	24.70%	2,179,646.06	24.70%	-
申万宏源	2	6,246,542,938.70	7.08%	624,704.84	7.08%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
英大证券	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。

11.7.2 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
华泰证券	43,670,281.59	65.99%	-	-	-	-
平安证券	10,780,105.90	16.29%	7,730,000,000.00	58.01%	-	-
申万宏源	11,727,799.70	17.72%	5,595,000,000.00	41.99%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加东北证券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	2019-01-16
2	南方基金关于淘宝直营店销售手续费费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-01-21
3	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加浙商证券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	2019-02-21
4	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加联讯证券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	2019-03-11
5	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券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	2019-07-09
6	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加国海证券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	2019-09-03
7	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-12-27

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
联接基金	1	20190306-20191231	1,366,573,402.00	1,643,203,600.00	1,132,000,000.00	1,877,777,002.00	24.06%
机构	1	20190909-20191231; 20190101-20190526; 20190528-20190618; 20190829-20190904	1,728,426,785.00	-	-	1,728,426,785.00	22.15%
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。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 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、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告》原文。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>