

南方中证 1000 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	12
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.....	13
§6 审计报告.....	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71

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	72
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	72
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	72
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	72
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12	投资组合报告附注	73
§9	基金份额持有人信息	74
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2	期末上市基金前十名持有人	74
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§10	开放式基金份额变动	75
§11	重大事件揭示	75
11.1	基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4	基金投资策略的改变	76
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8	其他重大事件	77
§12	影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
§13	备查文件目录	78
13.1	备查文件目录	78
13.2	存放地点	78
13.3	查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF（中证 1000ETF）
基金主代码	512100
交易代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	278,892,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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	10,333,882.66	-26,401,162.54	-10,105,676.50
本期利润	51,051,154.47	-42,998,159.44	-13,394,749.96
加权平均基金份额本期利润	0.1720	-0.2813	-0.1030
本期加权平均净值利润率	26.10%	-42.37%	-11.56%
本期基金份额净值增长率	34.60%	-35.49%	-13.08%
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	-79,784,917.84	-107,027,026.41	-21,847,640.83
期末可供分配基金份额利润	-0.2861	-0.4696	-0.1778
期末基金资产净值	199,107,082.16	120,864,973.59	101,044,359.17
期末基金份额净值	0.7139	0.5304	0.8222
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	-28.61%	-46.96%	-17.78%

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。

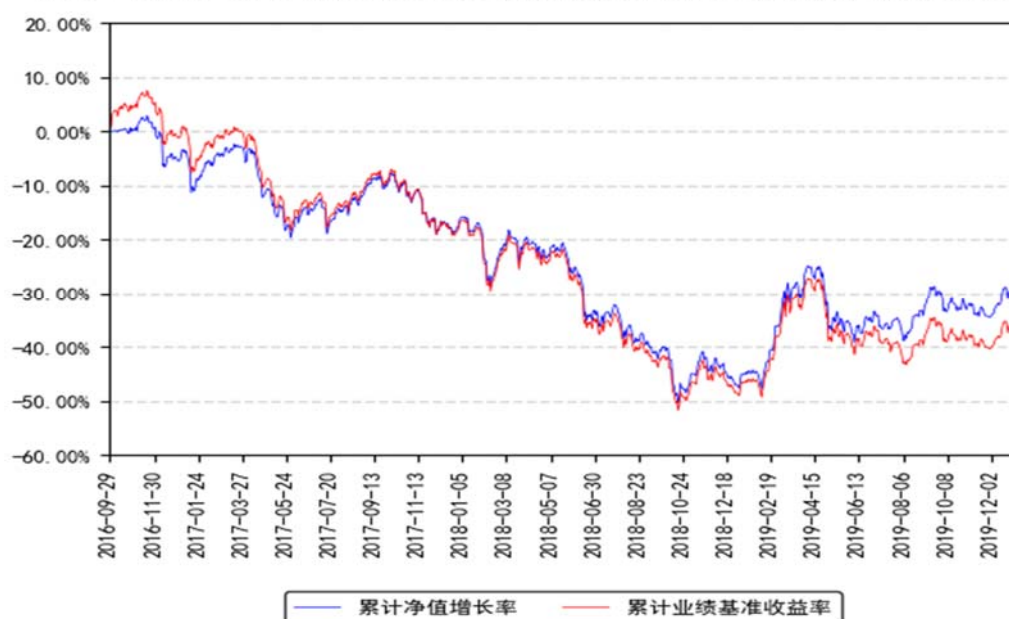
3.2 基金净值表现

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	7.32%	1.01%	6.40%	1.01%	0.92%	0.00%
过去六个月	10.49%	1.16%	4.62%	1.18%	5.87%	-0.02%
过去一年	34.60%	1.55%	25.67%	1.57%	8.93%	-0.02%
过去三年	-24.53%	1.40%	-34.44%	1.41%	9.91%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-28.61%	1.37%	-35.21%	1.38%	6.60%	-0.01%

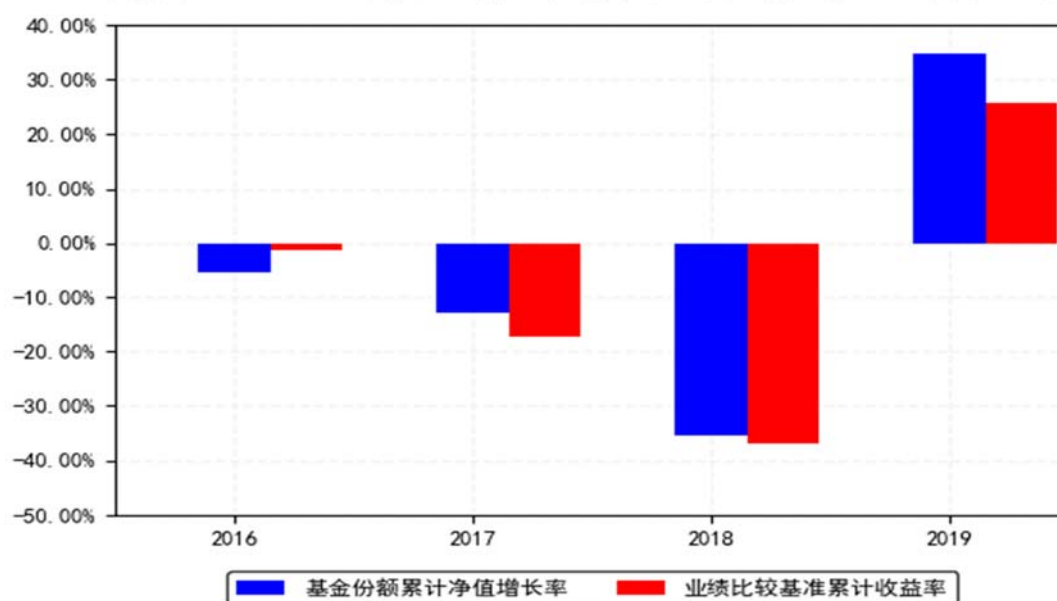
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效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1000ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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		
崔蕾	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	4 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理者(FRM)，特许金融分析师(CFA)，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF(QDII)基金经理；2019 年 6 月 28 日至今，任大数据 300 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF、南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，

					任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理。
周豪	本基金基金经理（已离任）	2016 年 9 月 29 日	2019 年 7 月 12 日	11 年	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任量化投资部高级研究员；2018 年 2 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；2016 年 4 月至 2019 年 7 月，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至 2019 年 7 月，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至 2019 年 7 月，任 1000ETF 基金经理；2017 年 8 月至 2019 年 7 月，任南方有色金属基金经理；2017 年 9 月至 2019 年 7 月，任南方有色金属联接基金经理；2018 年 1 月至 2019 年 7 月，任南方中证 100 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，两两组合间单日、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

本报告期内中证 1000 指数上涨 25.67%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 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）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

(3) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.7139 元，报告期内，份额净值增长率为 34.60%，同期业绩基准增长率为 25.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新冠疫情对短期经济增长形成了较大压力，但国家适时加强了逆周期政策调节力度以进行对冲，疫情一次性影响过去后，预计市场将重回基本面主导格局。当前 A 股市场整体估值仍具有较强吸引力，具备明显的长期配置价值。

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；本基金收益分配采取现金分红方式；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 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

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 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 21064 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	南方中证 1000 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>我们审计了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证 1000ETF 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 1000ETF 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>
形成审计意见的基础	<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 1000ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方中证 1000ETF 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 1000ETF 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 1000ETF 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 1000ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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 1000ETF 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 1000ETF 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：南方中证 1000 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	1,838,386.70	2,384,754.79
结算备付金		2,687,024.13	900,709.02
存出保证金		912,103.47	268,822.89
交易性金融资产	7.4.7.2	194,481,829.44	119,054,439.19
其中：股票投资		194,401,229.44	119,054,439.19
基金投资		-	-
债券投资		80,600.00	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,794.05	904.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		199,922,137.79	122,609,630.08
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		138,316.42	1,005,902.86
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		96,302.22	53,691.48
应付托管费		19,260.46	10,738.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	19,419.42	14,206.63
应交税费		18,825.28	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	522,931.83	660,117.21
负债合计		815,055.63	1,744,656.49
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	278,892,000.00	227,892,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-79,784,917.84	-107,027,026.41
所有者权益合计		199,107,082.16	120,864,973.59
负债和所有者权益总计		199,922,137.79	122,609,630.08

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7139 元，基金份额总额 278,892,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		53,621,362.97	-41,699,216.36
1. 利息收入		71,007.90	31,363.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	70,872.36	31,285.16
债券利息收入		135.54	78.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,635,111.99	-25,277,033.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,593,075.18	-25,504,380.02
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	22,364.32	-3,301.56
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	1,260,300.98	-641,000.00
股利收益	7.4.7.16	1,759,371.51	871,648.44
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	40,717,271.81	-16,596,996.90
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	2,197,971.27	143,449.69
减：二、费用		2,570,208.50	1,298,943.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	971,468.06	505,907.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	194,293.64	101,181.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	954,613.29	144,822.93
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		4,537.53	-
7. 其他费用	7.4.7.20	445,295.98	547,031.25
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		51,051,154.47	-42,998,159.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		51,051,154.47	-42,998,159.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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)	227,892,000.00	-107,027,026.41	120,864,973.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,051,154.47	51,051,154.47
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)	51,000,000.00	-23,809,045.90	27,190,954.10
其中：1. 基金申购款	1,242,000,000.00	-432,797,483.38	809,202,516.62
2. 基金赎回款	-1,191,000,000.00	408,988,437.48	-782,011,562.52
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)	278,892,000.00	-79,784,917.84	199,107,082.16
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)	122,892,000.00	-21,847,640.83	101,044,359.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,998,159.44	-42,998,159.44
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)	105,000,000.00	-42,181,226.14	62,818,773.86
其中：1. 基金申购款	258,000,000.00	-99,011,067.35	158,988,932.65
2. 基金赎回款	-153,000,000.00	56,829,841.21	-96,170,158.79
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)	227,892,000.00	-107,027,026.41	120,864,973.59

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

南方中证 1000 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[2016]366 号《关于准予南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《南方中证 1000 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 587,892,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 587,892,000.00 份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]264 号审核同意,本基金 587,892,000.00 份基金份额于 2016 年 11 月 4 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《南方中证 1000 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 1000 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)、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(但须符合中国证监会的相关规定)。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 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。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 1000 指数。

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》、《南方中证 1000 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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

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(主要为股指期货投资)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(主要为股指期货投资)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。

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。

(2) 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	1,838,386.70	2,384,754.79
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,838,386.70	2,384,754.79

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	182,677,772.18	194,401,229.44	11,723,457.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	80,600.00	80,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	80,600.00	80,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	182,758,372.18	194,481,829.44	11,723,457.26
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	147,952,803.74	119,054,439.19	-28,898,364.55
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	147,952,803.74	119,054,439.19	-28,898,364.55

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 60.00 元(2018 年 12 月 31 日:0.00 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	6,224,870.00	-	-	-
—股指期货	6,224,870.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,224,870.00	-	-	-
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	1,634,160.00	-	-	-
—股指期货	1,634,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,634,160.00	-	-	-

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	2	2,106,720.00	45,650.00
IC2002	IC2002	2	2,099,840.00	16,000.00
IC2003	IC2003	2	2,092,640.00	12,680.00
总额合计		6	6,299,200.00	74,330.00

减：可抵销期货暂收款	74,330.00
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

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

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	1,162.34	391.06
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,550.83	499.82
应收债券利息	3.55	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	77.33	13.31
合计	2,794.05	904.19

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	19,419.42	14,206.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	19,419.42	14,206.63

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	-	-
应退退补款	291,870.23	324,935.21
预提费用	175,000.00	284,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退退补款	6,061.60	1,182.00
其他	-	-
合计	522,931.83	660,117.21

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

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

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	227,892,000.00	227,892,000.00
本期申购	1,242,000,000.00	1,242,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,191,000,000.00	-1,191,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	278,892,000.00	278,892,000.00

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	-48,714,679.07	-58,312,347.34	-107,027,026.41
本期利润	10,333,882.66	40,717,271.81	51,051,154.47
本期基金份额交易产生的变动数	-11,795,129.77	-12,013,916.13	-23,809,045.90
其中：基金申购款	-250,204,121.38	-182,593,362.00	-432,797,483.38
基金赎回款	238,408,991.61	170,579,445.87	408,988,437.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,175,926.18	-29,608,991.66	-79,784,917.84

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	35,602.38	16,732.46

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	33,567.65	14,318.57
其他	1,702.33	234.13
合计	70,872.36	31,285.16

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	9,889,734.26	-19,321,286.33
股票投资收益——赎回差价收入	-2,296,659.08	-6,183,093.69
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	7,593,075.18	-25,504,380.02

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	655,179,594.48	98,793,443.33
减：卖出股票成本总额	645,289,860.22	118,114,729.66
买卖股票差价收入	9,889,734.26	-19,321,286.33

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	782,011,562.52	96,170,158.79
减：现金支付赎回款总额	505,755,332.52	64,011,310.79
减：赎回股票成本总额	278,552,889.08	38,341,941.69
赎回差价收入	-2,296,659.08	-6,183,093.69

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——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	316,799.86	105,389.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	294,300.00	108,600.00
减：应收利息总额	135.54	91.02
买卖债券差价收入	22,364.32	-3,301.56

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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	1,260,300.98	-641,000.00

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	1,759,371.51	871,648.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,759,371.51	871,648.44

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	40,621,821.81	-16,537,636.90
——股票投资	40,621,821.81	-16,539,526.46
——债券投资	-	1,889.56
——资产支持证券投资	-	-

——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	95,450.00	-59,360.00
——权证投资	-	-
——期货投资	95,450.00	-59,360.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	40,717,271.81	-16,596,996.90

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 60.00 元(2018 年度：0.00 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	2,197,971.27	143,449.69
合计	2,197,971.27	143,449.69

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	954,613.29	144,822.93
银行间市场交易费用	-	-
合计	954,613.29	144,822.93

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	55,000.00	54,000.00
信息披露费	120,000.00	230,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	10,295.98	3,031.25
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	445,295.98	547,031.25

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，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	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

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	
	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	230,138,595.00	17.19%	68,464,994.17	28.23%

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	23,014.85	17.19%	7,361.18	37.91%
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	6,848.09	28.23%	3,975.62	27.98%

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	971,468.06	505,907.42
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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

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

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	上年度可比期间 2018 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 12 月 31 日	1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	194,293.64	101,181.48

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

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

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

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

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

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

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

无。

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
招商银行	1,838,386.70	35,602.38	2,384,754.79	16,732.46

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

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。

7.4.11 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
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	-
688011	新光光电	2019 年 7 月 12 日	2020 年 1 月 22 日	科创板新股锁定期	38.09	41.05	8,807	335,458.63	361,527.35	-
688030	山石网科	2019 年 9 月 20 日	2020 年 3 月 30 日	科创板新股锁定期	21.06	37.90	5,967	125,665.02	226,149.30	-
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	-
688111	金山办公	2019 年 11 月 11 日	2020 年 5 月 18 日	科创板新股锁定期	45.86	128.63	6,282	288,092.52	808,053.66	-
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	1,794	78,900.12	78,900.12	-
688368	晶丰明源	2019 年 9 月 27 日	2020 年 4 月 14 日	科创板新股锁定期	56.68	75.13	1,704	96,582.72	128,021.52	-
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
113554	仙鹤转债	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 10 日	新债未上市	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.00	-
113558	日月转债	2019 年	2020 年	新债未上市	100.0	100.0	130	13,000.00	13,000.00	-

		12月24日	1月14日	上市	0	0				
128089	麦米转债	2019年12月26日	2020年1月21日	新债未上市	100.00	100.00	134	13,400.00	13,400.00	-
128090	汽模转2	2019年12月27日	2020年1月23日	新债未上市	100.00	100.00	112	11,200.00	11,200.00	-
128092	唐人转债	2019年12月30日	2020年1月22日	新债未上市	100.00	100.00	350	35,000.00	35,000.00	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002115	三维通信	2019年12月19日	重大事项停牌	8.89	2020年1月3日	9.08	28,470	236,596.18	253,098.30	-
600966	博汇纸业	2019年12月31日	重大事项停牌	5.31	2020年1月2日	5.84	37,900	156,963.70	201,249.00	-

本基金截至2019年12月31日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债

券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04% (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期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 1.12%。

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	1,838,386.70	-	-	-	1,838,386.70
结算备付金	2,687,024.13	-	-	-	2,687,024.13
存出保证金	156,199.47	-	-	755,904.00	912,103.47
交易性金融资产	-	-	80,600.00	194,401,229.44	194,481,829.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,794.05	2,794.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,681,610.30	-	80,600.00	195,159,927.49	199,922,137.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	96,302.22	96,302.22
应付托管费	-	-	-	19,260.46	19,260.46
应付证券清算款	-	-	-	138,316.42	138,316.42
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	19,419.42	19,419.42
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	18,825.28	18,825.28
其他负债	-	-	-	522,931.83	522,931.83
负债总计	-	-	-	815,055.63	815,055.63
利率敏感度缺口	4,681,610.30	-	80,600.00	194,344,871.86	199,107,082.16
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	2,384,754.79	-	-	-	2,384,754.79
结算备付金	900,709.02	-	-	-	900,709.02
存出保证金	26,866.89	-	-	241,956.00	268,822.89
交易性金融资产	-	-	-	119,054,439.19	119,054,439.19
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	904.19	904.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,312,330.70	-	-	119,297,299.38	122,609,630.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	53,691.48	53,691.48
应付托管费	-	-	-	10,738.31	10,738.31
应付证券清	-	-	-	1,005,902.86	1,005,902.86

算款					
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	14,206.63	14,206.63
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	660,117.21	660,117.21
负债总计	-	-	-	1,744,656.49	1,744,656.49
利率敏感度 缺口	3,312,330.70	-	-	117,552,642.8 9	120,864,973. 59

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

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 0.04%(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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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	194,401,229.44	97.64	119,054,439.19	98.50
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	194,401,229.44	97.64	119,054,439.19	98.50

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(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末(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%	9,768,193.45	6,001,550.26
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-9,768,193.45	-6,001,550.26

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 809,202,516.62 元(2018 年度:158,988,932.65 元),其中包括以股票支付的申购款 262,045,112.15 元和以现金支付的申购款 547,157,404.47 元(2018 年度:其中包括以股票支付的申购款 49,144,879.80 元和以现金支付的申购款 109,844,052.85 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 192,248,706.02 元，属于第二层次的余额为 2,233,123.42 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 118,967,365.19 元，第二层次 87,074.00 元，无第三层次)。

(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

无。

(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	194,401,229.44	97.24
	其中：股票	194,401,229.44	97.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,600.00	0.04
	其中：债券	80,600.00	0.04

	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	4,525,410.83	2.26
8	其他资产	914,897.52	0.46
9	合计	199,922,137.79	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

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	2,236,569.55	1.12
B	采矿业	3,800,987.66	1.91
C	制造业	121,566,812.67	61.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,339,712.28	2.18
E	建筑业	4,596,252.65	2.31
F	批发和零售业	6,598,493.02	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	4,345,352.12	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,616,299.85	12.36
J	金融业	1,954,456.90	0.98
K	房地产业	6,726,202.62	3.38
L	租赁和商务服务业	2,196,184.90	1.10
M	科学研究和技术服务业	2,712,924.17	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	2,707,340.40	1.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	122,640.00	0.06
Q	卫生和社会工作	626,506.76	0.31
R	文化、体育和娱乐业	2,470,784.76	1.24
S	综合	1,042,083.00	0.52
	合计	192,659,603.31	96.76

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	571,401.41	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	1,162,224.48	0.58
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	1,741,566.13	0.87

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	002405	四维图新	74,200	1,194,620.00	0.60
2	300450	先导智能	25,000	1,123,500.00	0.56
3	300271	华宇软件	30,600	777,240.00	0.39
4	002185	华天科技	103,677	774,467.19	0.39
5	300661	圣邦股份	2,980	752,390.40	0.38
6	002138	顺络电子	30,500	704,550.00	0.35
7	002396	星网锐捷	19,300	686,308.00	0.34
8	000540	中天金融	198,700	661,671.00	0.33
9	300357	我武生物	14,860	656,069.00	0.33
10	300558	贝达药业	9,500	624,150.00	0.31

11	300212	易华录	18,000	601,920.00	0.30
12	300782	卓胜微	1,400	574,518.00	0.29
13	300699	光威复材	12,220	556,010.00	0.28
14	600529	山东药玻	19,724	545,171.36	0.27
15	300618	寒锐钴业	6,356	523,670.84	0.26
16	300676	华大基因	7,600	522,120.00	0.26
17	300496	中科创达	11,400	514,596.00	0.26
18	002123	梦网集团	26,600	508,858.00	0.26
19	600797	浙大网新	49,500	498,465.00	0.25
20	300223	北京君正	5,699	496,667.85	0.25
21	300379	东方通	10,500	485,625.00	0.24
22	002124	天邦股份	38,350	481,292.50	0.24
23	300369	绿盟科技	26,400	478,368.00	0.24
24	300226	上海钢联	6,000	466,800.00	0.23
25	300326	凯利泰	34,200	463,410.00	0.23
26	002036	联创电子	27,100	460,971.00	0.23
27	000818	航锦科技	22,900	457,542.00	0.23
28	600873	梅花生物	102,700	457,015.00	0.23
29	300073	当升科技	16,500	450,450.00	0.23
30	600635	大众公用	91,500	449,265.00	0.23
31	002156	通富微电	27,300	449,085.00	0.23
32	000735	罗牛山	43,600	442,976.00	0.22
33	002035	华帝股份	33,000	442,860.00	0.22
34	600641	万业企业	22,900	430,520.00	0.22
35	600252	中恒集团	131,500	428,690.00	0.22
36	002675	东诚药业	26,600	428,526.00	0.22
37	300747	锐科激光	3,600	424,080.00	0.21
38	300457	赢合科技	12,450	422,677.50	0.21
39	300482	万孚生物	8,102	419,440.54	0.21
40	601636	旗滨集团	76,200	418,338.00	0.21
41	002402	和而泰	32,350	418,285.50	0.21
42	300339	润和软件	30,100	417,487.00	0.21
43	300118	东方日升	29,800	412,730.00	0.21
44	002648	卫星石化	25,200	412,020.00	0.21
45	001914	招商积余	20,100	407,829.00	0.20
46	002557	洽洽食品	12,000	407,640.00	0.20
47	002436	兴森科技	49,200	400,488.00	0.20
48	300079	数码科技	67,600	400,192.00	0.20
49	601058	赛轮轮胎	89,400	399,618.00	0.20
50	300352	北信源	54,800	399,492.00	0.20
51	600864	哈投股份	49,100	395,746.00	0.20
52	002080	中材科技	31,776	394,022.40	0.20
53	002643	万润股份	25,850	392,661.50	0.20

54	300037	新宙邦	10,800	392,472.00	0.20
55	300188	美亚柏科	22,880	391,248.00	0.20
56	002511	中顺洁柔	30,895	391,130.70	0.20
57	002063	远光软件	32,200	388,010.00	0.19
58	000799	酒鬼酒	10,800	387,180.00	0.19
59	002458	益生股份	13,640	386,694.00	0.19
60	002100	天康生物	30,100	384,678.00	0.19
61	000800	一汽轿车	38,400	382,848.00	0.19
62	300294	博雅生物	12,250	382,567.50	0.19
63	600323	瀚蓝环境	21,700	380,618.00	0.19
64	600812	华北制药	38,500	378,840.00	0.19
65	002683	宏大爆破	20,000	377,000.00	0.19
66	300451	创业慧康	21,000	376,740.00	0.19
67	600601	方正科技	102,600	375,516.00	0.19
68	000710	贝瑞基因	10,100	369,660.00	0.19
69	600720	祁连山	29,300	367,715.00	0.18
70	300630	普利制药	6,469	366,404.16	0.18
71	000591	太阳能	99,540	364,316.40	0.18
72	002237	恒邦股份	25,800	362,232.00	0.18
73	300595	欧普康视	7,640	361,601.20	0.18
74	000516	国际医学	74,500	361,325.00	0.18
75	000917	电广传媒	53,600	361,264.00	0.18
76	000831	五矿稀土	27,830	360,676.80	0.18
77	000739	普洛药业	27,800	360,566.00	0.18
78	300476	胜宏科技	22,060	359,798.60	0.18
79	002597	金禾实业	15,900	359,499.00	0.18
80	300463	迈克生物	13,200	356,004.00	0.18
81	000672	上峰水泥	19,200	351,168.00	0.18
82	002151	北斗星通	13,900	350,836.00	0.18
83	300078	思创医惠	28,420	348,997.60	0.18
84	600711	盛屯矿业	65,400	345,966.00	0.17
85	300098	高新兴	58,320	345,837.60	0.17
86	002023	海特高新	28,600	344,630.00	0.17
87	002332	仙琚制药	34,700	342,489.00	0.17
88	600320	振华重工	94,180	341,873.40	0.17
89	600206	有研新材	28,000	341,600.00	0.17
90	600490	鹏欣资源	73,300	340,845.00	0.17
91	300036	超图软件	17,000	338,810.00	0.17
92	601375	中原证券	63,200	338,752.00	0.17
93	600305	恒顺醋业	22,200	338,550.00	0.17
94	600702	舍得酒业	11,200	336,112.00	0.17
95	603222	济民制药	6,100	335,500.00	0.17
96	300474	景嘉微	5,700	333,906.00	0.17

97	600559	老白干酒	29,704	333,872.96	0.17
98	300053	欧比特	26,600	330,372.00	0.17
99	002099	海翔药业	45,900	326,808.00	0.16
100	300170	汉得信息	33,600	325,584.00	0.16
101	002025	航天电器	12,200	324,154.00	0.16
102	002568	百润股份	12,300	323,121.00	0.16
103	600667	太极实业	39,800	322,778.00	0.16
104	300054	鼎龙股份	32,480	321,552.00	0.16
105	603345	安井食品	5,400	320,814.00	0.16
106	002292	奥飞娱乐	32,100	318,753.00	0.16
107	600756	浪潮软件	15,400	318,472.00	0.16
108	000667	美好置业	116,600	318,318.00	0.16
109	300567	精测电子	5,800	318,072.00	0.16
110	600491	龙元建设	43,400	317,254.00	0.16
111	002351	漫步者	14,100	317,250.00	0.16
112	002042	华孚时尚	43,100	316,354.00	0.16
113	300322	硕贝德	15,400	315,084.00	0.16
114	002912	中新赛克	2,500	315,000.00	0.16
115	002727	一心堂	13,400	311,684.00	0.16
116	600986	科达股份	62,640	310,694.40	0.16
117	300068	南都电源	28,800	310,464.00	0.16
118	600868	梅雁吉祥	89,700	309,465.00	0.16
119	600803	新奥股份	29,000	308,560.00	0.15
120	000034	神州数码	15,500	307,675.00	0.15
121	600850	华东电脑	12,100	306,856.00	0.15
122	002547	春兴精工	37,300	306,606.00	0.15
123	600621	华鑫股份	20,000	306,200.00	0.15
124	600330	天通股份	37,640	302,625.60	0.15
125	002126	银轮股份	37,400	302,566.00	0.15
126	002261	拓维信息	36,400	301,392.00	0.15
127	300458	全志科技	9,408	300,961.92	0.15
128	002449	国星光电	23,450	299,925.50	0.15
129	300456	耐威科技	12,130	298,640.60	0.15
130	002429	兆驰股份	85,700	298,236.00	0.15
131	002389	航天彩虹	26,800	297,480.00	0.15
132	601519	大智慧	37,600	296,664.00	0.15
133	600093	易见股份	21,200	295,952.00	0.15
134	000933	神火股份	53,900	295,372.00	0.15
135	600604	市北高新	33,300	295,038.00	0.15
136	000683	远兴能源	129,800	294,646.00	0.15
137	000035	中国天楹	47,700	294,309.00	0.15
138	002020	京新药业	27,400	294,276.00	0.15
139	603678	火炬电子	12,800	293,632.00	0.15

140	002697	红旗连锁	38,600	291,430.00	0.15
141	603368	柳药股份	8,592	289,034.88	0.15
142	300724	捷佳伟创	7,600	287,964.00	0.14
143	002326	永太科技	29,072	287,812.80	0.14
144	000560	我爱我家	66,730	287,606.30	0.14
145	300038	数知科技	33,300	287,046.00	0.14
146	300348	长亮科技	13,700	286,604.00	0.14
147	000951	中国重汽	12,700	285,750.00	0.14
148	600612	老凤祥	6,000	285,660.00	0.14
149	002079	苏州固锝	24,100	285,344.00	0.14
150	002276	万马股份	34,300	285,033.00	0.14
151	600131	岷江水电	14,300	283,426.00	0.14
152	600185	格力地产	58,500	283,140.00	0.14
153	600984	建设机械	27,400	283,042.00	0.14
154	300130	新国都	16,040	282,785.20	0.14
155	603737	三棵树	3,500	282,275.00	0.14
156	002497	雅化集团	36,300	282,051.00	0.14
157	000968	蓝焰控股	27,400	281,124.00	0.14
158	300725	药石科技	4,110	280,836.30	0.14
159	002262	恩华药业	24,140	280,748.20	0.14
160	002481	双塔食品	35,300	280,282.00	0.14
161	600072	中船科技	20,900	279,642.00	0.14
162	600226	瀚叶股份	88,994	279,441.16	0.14
163	300685	艾德生物	4,180	279,307.60	0.14
164	603708	家家悦	11,462	278,985.08	0.14
165	300616	尚品宅配	3,740	278,704.80	0.14
166	002413	雷科防务	51,100	277,984.00	0.14
167	000789	万年青	22,670	276,800.70	0.14
168	002851	麦格米特	13,350	276,612.00	0.14
169	000059	华锦股份	45,400	276,486.00	0.14
170	002467	二六三	51,180	275,860.20	0.14
171	600771	广誉远	16,260	275,769.60	0.14
172	002234	民和股份	8,600	273,566.00	0.14
173	002610	爱康科技	169,800	273,378.00	0.14
174	000555	神州信息	18,300	271,023.00	0.14
175	600422	昆药集团	25,200	270,396.00	0.14
176	002216	三全食品	18,900	270,270.00	0.14
177	600483	福能股份	29,300	269,560.00	0.14
178	000697	炼石航空	25,400	269,240.00	0.14
179	300502	新易盛	6,700	268,938.00	0.14
180	002446	盛路通信	29,610	267,970.50	0.13
181	002376	新北洋	22,000	266,200.00	0.13
182	002733	雄韬股份	9,900	266,112.00	0.13

183	002531	天顺风能	42,100	266,072.00	0.13
184	300666	江丰电子	6,200	265,980.00	0.13
185	600517	置信电气	32,143	264,858.32	0.13
186	600596	新安股份	26,700	262,728.00	0.13
187	300284	苏交科	32,156	262,714.52	0.13
188	000921	海信家电	21,300	262,629.00	0.13
189	600546	山煤国际	37,500	261,750.00	0.13
190	600337	美克家居	58,702	260,049.86	0.13
191	000650	仁和药业	41,000	259,120.00	0.13
192	300232	洲明科技	26,134	258,987.94	0.13
193	300085	银之杰	16,700	258,516.00	0.13
194	600668	尖峰集团	16,300	257,540.00	0.13
195	600363	联创光电	16,800	256,872.00	0.13
196	600764	中国海防	9,000	256,140.00	0.13
197	603605	珀莱雅	2,900	255,345.00	0.13
198	000875	吉电股份	81,200	254,968.00	0.13
199	600110	诺德股份	54,400	254,592.00	0.13
200	000793	华闻集团	75,500	254,435.00	0.13
201	002091	江苏国泰	36,930	253,709.10	0.13
202	002115	三维通信	28,470	253,098.30	0.13
203	600562	国睿科技	17,610	252,527.40	0.13
204	300679	电连技术	6,627	252,157.35	0.13
205	000070	特发信息	23,140	251,069.00	0.13
206	300203	聚光科技	15,000	250,650.00	0.13
207	002705	新宝股份	15,200	250,648.00	0.13
208	600602	云赛智联	30,400	250,496.00	0.13
209	000733	振华科技	14,600	250,390.00	0.13
210	600993	马应龙	14,300	250,107.00	0.13
211	300523	辰安科技	5,570	249,870.20	0.13
212	600063	皖维高新	63,700	249,704.00	0.13
213	002168	惠程科技	30,300	248,460.00	0.12
214	000851	高鸿股份	42,980	248,424.40	0.12
215	600831	广电网络	26,800	248,168.00	0.12
216	300602	飞荣达	5,850	248,040.00	0.12
217	600456	宝钛股份	10,200	247,758.00	0.12
218	601588	北辰实业	75,400	247,312.00	0.12
219	603118	共进股份	22,000	247,280.00	0.12
220	002192	融捷股份	9,800	246,372.00	0.12
221	002649	博彦科技	24,800	246,016.00	0.12
222	600378	昊华科技	12,700	245,237.00	0.12
223	002430	杭氧股份	18,200	244,972.00	0.12
224	603399	吉翔股份	18,100	244,350.00	0.12
225	000603	盛达资源	16,300	244,337.00	0.12

226	000931	中 关 村	24,900	244,269.00	0.12
227	300292	吴通控股	48,200	243,410.00	0.12
228	000902	新 洋 丰	30,800	243,320.00	0.12
229	601567	三星医疗	32,800	242,720.00	0.12
230	601222	林洋能源	49,900	242,514.00	0.12
231	002097	山河智能	41,157	242,003.16	0.12
232	300377	赢 时 胜	21,050	241,864.50	0.12
233	600503	华丽家族	75,700	240,726.00	0.12
234	300300	汉鼎宇佑	22,550	240,608.50	0.12
235	600360	华微电子	36,500	240,535.00	0.12
236	601011	宝 泰 隆	53,300	240,383.00	0.12
237	000049	德赛电池	5,900	240,366.00	0.12
238	600789	鲁抗医药	33,330	240,309.30	0.12
239	600326	西藏天路	32,720	239,837.60	0.12
240	000810	创维数字	20,000	239,800.00	0.12
241	000546	金圆股份	23,700	239,370.00	0.12
242	002488	金固股份	33,500	238,855.00	0.12
243	603638	艾迪精密	7,832	238,562.72	0.12
244	600761	安徽合力	24,500	238,385.00	0.12
245	601918	新集能源	73,500	238,140.00	0.12
246	300303	聚飞光电	42,300	237,303.00	0.12
247	000926	福星股份	36,400	236,600.00	0.12
248	000915	山大华特	8,910	236,115.00	0.12
249	002657	中科金财	12,700	235,458.00	0.12
250	601677	明泰铝业	20,400	235,212.00	0.12
251	603026	石大胜华	6,700	234,634.00	0.12
252	002171	楚江新材	31,600	234,156.00	0.12
253	300770	新媒股份	1,800	234,000.00	0.12
254	603027	千禾味业	11,000	233,860.00	0.12
255	603043	广州酒家	7,700	233,849.00	0.12
256	002512	达华智能	36,200	233,490.00	0.12
257	600284	浦东建设	36,700	233,045.00	0.12
258	002777	久远银海	6,400	232,960.00	0.12
259	000976	华铁股份	45,300	232,842.00	0.12
260	601163	三角轮胎	15,200	232,560.00	0.12
261	600742	一汽富维	19,160	231,644.40	0.12
262	000016	深康佳 A	52,900	231,173.00	0.12
263	002421	达实智能	64,000	231,040.00	0.12
264	002145	中核钛白	52,700	230,299.00	0.12
265	600685	中船防务	15,600	230,100.00	0.12
266	300748	金力永磁	5,900	229,864.00	0.12
267	300236	上海新阳	8,300	229,661.00	0.12
268	600269	赣粤高速	55,200	227,976.00	0.11

269	002798	帝欧家居	9,100	227,955.00	0.11
270	002022	科华生物	19,500	227,760.00	0.11
271	000901	航天科技	20,300	227,360.00	0.11
272	000676	智度股份	25,080	226,723.20	0.11
273	300735	光弘科技	8,680	226,374.40	0.11
274	002626	金达威	11,600	226,200.00	0.11
275	603323	吴江银行	42,690	225,830.10	0.11
276	002117	东港股份	18,100	225,345.00	0.11
277	000708	中信特钢	9,800	224,714.00	0.11
278	002565	顺灏股份	35,100	224,640.00	0.11
279	600851	海欣股份	27,900	224,316.00	0.11
280	601666	平煤股份	55,800	224,316.00	0.11
281	002318	久立特材	23,900	224,182.00	0.11
282	002618	丹邦科技	18,150	223,789.50	0.11
283	002251	步步高	24,500	222,950.00	0.11
284	000688	国城矿业	16,200	222,102.00	0.11
285	600783	鲁信创投	14,100	221,934.00	0.11
286	002611	东方精工	52,200	221,850.00	0.11
287	600988	赤峰黄金	44,100	221,823.00	0.11
288	300185	通裕重工	123,600	221,244.00	0.11
289	300572	安车检测	4,600	221,168.00	0.11
290	002647	仁东控股	13,200	220,968.00	0.11
291	300145	中金环境	63,660	220,900.20	0.11
292	600846	同济科技	23,700	220,647.00	0.11
293	300233	金城医药	11,100	220,335.00	0.11
294	600624	复旦复华	22,700	219,963.00	0.11
295	600587	新华医疗	15,400	219,912.00	0.11
296	000910	大亚圣象	15,700	219,643.00	0.11
297	000900	现代投资	50,300	219,308.00	0.11
298	002047	宝鹰股份	38,000	219,260.00	0.11
299	601929	吉视传媒	102,900	219,177.00	0.11
300	600459	贵研铂业	14,506	219,040.60	0.11
301	300256	星星科技	36,250	218,950.00	0.11
302	300055	万邦达	32,800	218,776.00	0.11
303	600366	宁波韵升	32,800	218,448.00	0.11
304	603596	伯特利	9,700	218,250.00	0.11
305	002400	省广集团	65,900	217,470.00	0.11
306	002639	雪人股份	25,500	217,260.00	0.11
307	002343	慈文传媒	17,920	217,011.20	0.11
308	300353	东土科技	16,900	216,658.00	0.11
309	300596	利安隆	5,900	216,589.00	0.11
310	300327	中颖电子	8,400	216,384.00	0.11
311	600210	紫江企业	57,300	216,021.00	0.11

312	002489	浙江永强	51,500	215,785.00	0.11
313	300438	鹏辉能源	8,000	214,400.00	0.11
314	600108	亚盛集团	73,600	214,176.00	0.11
315	600740	山西焦化	28,700	214,102.00	0.11
316	002139	拓邦股份	38,500	214,060.00	0.11
317	600116	三峡水利	28,200	214,038.00	0.11
318	603456	九洲药业	15,300	213,282.00	0.11
319	002530	金财互联	18,400	212,888.00	0.11
320	002567	唐人神	23,750	212,800.00	0.11
321	600936	广西广电	55,300	212,352.00	0.11
322	000592	平潭发展	73,100	211,990.00	0.11
323	600057	厦门象屿	51,066	211,923.90	0.11
324	600285	羚锐制药	21,400	211,860.00	0.11
325	000836	富通鑫茂	57,100	211,841.00	0.11
326	002301	齐心集团	17,400	211,584.00	0.11
327	601369	陕鼓动力	31,800	211,470.00	0.11
328	000036	华联控股	49,050	211,405.50	0.11
329	002859	洁美科技	6,100	211,121.00	0.11
330	002254	泰和新材	20,200	211,090.00	0.11
331	600146	商赢环球	15,600	210,600.00	0.11
332	600611	大众交通	51,800	210,308.00	0.11
333	002428	云南锗业	24,700	210,197.00	0.11
334	600129	太极集团	18,400	209,208.00	0.11
335	300287	飞利信	54,300	208,512.00	0.10
336	600123	兰花科创	32,400	208,008.00	0.10
337	000582	北部湾港	23,200	207,640.00	0.10
338	002073	软控股份	44,200	206,856.00	0.10
339	000088	盐田港	36,700	206,621.00	0.10
340	300664	鹏鹞环保	15,900	206,064.00	0.10
341	002130	沃尔核材	41,700	205,998.00	0.10
342	002537	海联金汇	29,340	205,966.80	0.10
343	000040	东旭蓝天	49,200	205,656.00	0.10
344	002717	岭南股份	43,635	205,084.50	0.10
345	600990	四创电子	4,600	205,068.00	0.10
346	002409	雅克科技	8,800	204,160.00	0.10
347	000429	粤高速 A	24,700	204,022.00	0.10
348	002313	日海智能	10,300	203,940.00	0.10
349	000958	东方能源	36,500	203,670.00	0.10
350	000918	嘉凯城	34,100	203,577.00	0.10
351	002698	博实股份	19,350	203,562.00	0.10
352	002104	恒宝股份	26,416	202,082.40	0.10
353	300429	强力新材	12,120	202,040.40	0.10
354	300184	力源信息	27,820	201,695.00	0.10

355	600966	博汇纸业	37,900	201,249.00	0.10
356	603606	东方电缆	18,300	200,934.00	0.10
357	300137	先河环保	26,020	199,833.60	0.10
358	000720	新能泰山	36,600	199,470.00	0.10
359	300568	星源材质	6,600	199,386.00	0.10
360	300298	三诺生物	13,280	199,067.20	0.10
361	002222	福晶科技	16,200	198,774.00	0.10
362	600502	安徽建工	48,800	198,128.00	0.10
363	600496	精工钢构	68,500	197,965.00	0.10
364	300401	花园生物	15,900	197,955.00	0.10
365	002182	云海金属	21,400	197,950.00	0.10
366	600169	太原重工	84,800	197,584.00	0.10
367	300177	中海达	22,250	197,580.00	0.10
368	603599	广信股份	13,156	197,208.44	0.10
369	000936	华西股份	25,200	196,812.00	0.10
370	002383	合众思壮	21,100	196,652.00	0.10
371	300031	宝通科技	13,100	196,500.00	0.10
372	000795	英洛华	32,200	196,098.00	0.10
373	603718	海利生物	15,300	195,840.00	0.10
374	600059	古越龙山	23,000	195,730.00	0.10
375	600261	阳光照明	41,200	195,700.00	0.10
376	300737	科顺股份	17,200	194,704.00	0.10
377	002550	千红制药	42,400	194,192.00	0.10
378	000726	鲁泰 A	21,200	193,980.00	0.10
379	000969	安泰科技	29,100	193,806.00	0.10
380	002617	露笑科技	35,750	193,765.00	0.10
381	600531	豫光金铅	41,300	193,697.00	0.10
382	600775	南京熊猫	19,000	193,040.00	0.10
383	300047	天源迪科	24,159	192,305.64	0.10
384	002303	美盈森	36,200	192,222.00	0.10
385	300406	九强生物	11,800	191,868.00	0.10
386	000682	东方电子	38,000	191,520.00	0.10
387	300222	科大智能	20,500	191,265.00	0.10
388	300238	冠昊生物	10,000	191,100.00	0.10
389	600736	苏州高新	32,700	190,641.00	0.10
390	603881	数据港	5,000	189,750.00	0.10
391	603236	移远通信	1,300	189,670.00	0.10
392	300527	中国应急	17,335	189,644.90	0.10
393	002832	比音勒芬	7,300	189,581.00	0.10
394	002498	汉缆股份	62,900	189,329.00	0.10
395	300045	华力创通	20,300	189,196.00	0.10
396	001696	宗申动力	32,500	189,150.00	0.09
397	002822	中装建设	19,100	188,899.00	0.09

398	002043	兔宝宝	25,700	188,895.00	0.09
399	300083	劲胜智能	47,300	188,727.00	0.09
400	000802	北京文化	20,300	188,587.00	0.09
401	000507	珠海港	30,700	188,498.00	0.09
402	300149	量子生物	14,200	188,292.00	0.09
403	603012	创力集团	21,000	187,320.00	0.09
404	601010	文峰股份	61,200	187,272.00	0.09
405	300194	福安药业	33,800	187,252.00	0.09
406	300311	任子行	19,305	187,065.45	0.09
407	600020	中原高速	42,500	187,000.00	0.09
408	600750	江中药业	14,900	186,697.00	0.09
409	002341	新纶科技	32,700	185,736.00	0.09
410	600105	永鼎股份	41,240	185,580.00	0.09
411	600708	光明地产	52,704	185,518.08	0.09
412	600681	百川能源	27,260	185,368.00	0.09
413	002364	中恒电气	16,000	185,120.00	0.09
414	600175	美都能源	101,400	184,548.00	0.09
415	300349	金卡智能	12,100	184,525.00	0.09
416	000829	天音控股	29,400	184,338.00	0.09
417	600162	香江控股	80,300	183,887.00	0.09
418	603660	苏州科达	16,672	183,392.00	0.09
419	002108	沧州明珠	46,889	183,335.99	0.09
420	300363	博腾股份	12,800	183,168.00	0.09
421	002605	姚记科技	9,400	182,830.00	0.09
422	601137	博威合金	16,200	182,412.00	0.09
423	300020	银江股份	21,700	182,280.00	0.09
424	300741	华宝股份	5,900	182,192.00	0.09
425	002850	科达利	4,000	182,000.00	0.09
426	601890	亚星锚链	31,800	181,896.00	0.09
427	300266	兴源环境	51,800	181,818.00	0.09
428	002484	江海股份	23,190	181,809.60	0.09
429	300131	英唐智控	35,400	181,602.00	0.09
430	300007	汉威科技	11,100	181,596.00	0.09
431	603588	高能环境	19,100	181,450.00	0.09
432	600200	江苏吴中	33,700	181,306.00	0.09
433	300355	蒙草生态	53,140	181,207.40	0.09
434	601069	西部黄金	12,000	181,200.00	0.09
435	603018	中设集团	17,600	181,104.00	0.09
436	300123	亚光科技	23,860	181,097.40	0.09
437	603128	华贸物流	28,700	181,097.00	0.09
438	300043	星辉娱乐	35,300	181,089.00	0.09
439	600103	青山纸业	87,280	180,669.60	0.09
440	300323	华灿光电	25,800	180,600.00	0.09

441	002367	康力电梯	22,700	180,465.00	0.09
442	603068	博通集成	2,000	180,140.00	0.09
443	300366	创意信息	17,400	179,916.00	0.09
444	002320	海峡股份	14,050	179,840.00	0.09
445	300394	天孚通信	4,700	179,822.00	0.09
446	603127	昭衍新药	3,100	179,180.00	0.09
447	300487	蓝晓科技	4,900	178,850.00	0.09
448	002545	东方铁塔	23,600	178,180.00	0.09
449	000935	四川双马	10,800	178,092.00	0.09
450	002747	埃斯顿	15,800	177,908.00	0.09
451	300034	钢研高纳	11,100	177,267.00	0.09
452	002515	金字火腿	32,460	177,231.60	0.09
453	600308	华泰股份	38,600	177,174.00	0.09
454	002596	海南瑞泽	27,200	176,800.00	0.09
455	603393	新天然气	6,360	176,744.40	0.09
456	600331	宏达股份	67,200	176,736.00	0.09
457	300495	美尚生态	15,950	176,726.00	0.09
458	002474	榕基软件	20,600	176,130.00	0.09
459	300510	金冠股份	25,099	175,693.00	0.09
460	002067	景兴纸业	52,600	175,684.00	0.09
461	300477	合纵科技	23,680	175,232.00	0.09
462	002258	利尔化学	12,400	175,212.00	0.09
463	000882	华联股份	77,700	174,825.00	0.09
464	600114	东睦股份	20,372	174,791.76	0.09
465	002668	奥马电器	30,756	173,771.40	0.09
466	002663	普邦股份	59,500	173,740.00	0.09
467	600577	精达股份	63,600	173,628.00	0.09
468	002274	华昌化工	27,000	173,610.00	0.09
469	600420	现代制药	19,400	173,436.00	0.09
470	000996	中国中期	16,350	173,310.00	0.09
471	601700	风范股份	26,800	173,128.00	0.09
472	002298	中电兴发	22,900	173,124.00	0.09
473	000796	凯撒旅业	19,000	173,090.00	0.09
474	603113	金能科技	16,000	172,640.00	0.09
475	603308	应流股份	11,500	172,615.00	0.09
476	002215	诺普信	25,900	172,494.00	0.09
477	600477	杭萧钢构	61,100	172,302.00	0.09
478	000751	锌业股份	53,300	172,159.00	0.09
479	603686	龙马环卫	15,760	172,099.20	0.09
480	603008	喜临门	11,100	171,717.00	0.09
481	300367	东方网力	39,509	171,073.97	0.09
482	002792	通宇通讯	6,400	171,008.00	0.09
483	300702	天宇股份	3,400	170,408.00	0.09

484	300044	赛为智能	26,220	170,167.80	0.09
485	600512	腾达建设	60,500	170,005.00	0.09
486	002746	仙坛股份	10,915	169,946.55	0.09
487	600552	凯盛科技	28,900	169,932.00	0.09
488	600971	恒源煤电	28,400	169,832.00	0.09
489	000973	佛塑科技	36,600	169,824.00	0.09
490	300310	宜通世纪	33,340	169,700.60	0.09
491	300607	拓斯达	3,547	169,546.60	0.09
492	000601	韶能股份	30,591	169,474.14	0.09
493	600067	冠城大通	42,400	168,752.00	0.08
494	603039	泛微网络	2,884	168,714.00	0.08
495	300101	振芯科技	18,500	168,535.00	0.08
496	300198	纳川股份	39,000	168,480.00	0.08
497	300623	捷捷微电	6,400	168,448.00	0.08
498	600217	中再资环	32,900	168,448.00	0.08
499	300091	金通灵	40,780	168,013.60	0.08
500	600658	电子城	31,800	167,904.00	0.08
501	603383	顶点软件	2,300	167,831.00	0.08
502	600495	晋西车轴	39,925	167,685.00	0.08
503	000666	经纬纺机	14,900	167,625.00	0.08
504	600197	伊力特	10,400	166,712.00	0.08
505	600978	宜华生活	56,100	166,617.00	0.08
506	300128	锦富技术	41,405	166,448.10	0.08
507	000903	云内动力	65,200	166,260.00	0.08
508	600622	光大嘉宝	42,541	165,909.90	0.08
509	603508	思维列控	2,800	165,704.00	0.08
510	600343	航天动力	18,100	165,615.00	0.08
511	002235	安妮股份	19,200	165,312.00	0.08
512	002243	通产丽星	11,000	165,000.00	0.08
513	600790	轻纺城	48,500	164,900.00	0.08
514	300773	拉卡拉	2,100	164,787.00	0.08
515	002031	巨轮智能	83,200	164,736.00	0.08
516	002167	东方锆业	23,500	164,500.00	0.08
517	601949	中国出版	25,900	163,947.00	0.08
518	603108	润达医疗	16,480	163,811.20	0.08
519	600997	开滦股份	30,000	163,200.00	0.08
520	600300	维维股份	55,300	163,135.00	0.08
521	002677	浙江美大	12,200	162,992.00	0.08
522	002510	天汽模	34,800	162,516.00	0.08
523	300183	东软载波	11,100	162,504.00	0.08
524	002737	葵花药业	11,000	162,360.00	0.08
525	600987	航民股份	25,565	161,826.45	0.08
526	300075	数字政通	14,200	161,738.00	0.08

527	002226	江南化工	29,500	161,660.00	0.08
528	000520	长航凤凰	38,300	161,626.00	0.08
529	000828	东莞控股	19,600	161,504.00	0.08
530	300102	乾照光电	34,000	161,500.00	0.08
531	600400	红豆股份	47,920	161,011.20	0.08
532	002041	登海种业	16,700	160,821.00	0.08
533	300328	宜安科技	10,900	160,666.00	0.08
534	002095	生意宝	7,200	160,416.00	0.08
535	603989	艾华集团	7,350	160,377.00	0.08
536	002447	晨鑫科技	47,200	160,008.00	0.08
537	300759	康龙化成	3,100	159,774.00	0.08
538	002135	东南网架	29,300	159,685.00	0.08
539	000597	东北制药	21,399	159,636.54	0.08
540	300114	中航电测	14,000	159,320.00	0.08
541	300571	平治信息	2,900	159,152.00	0.08
542	002695	煌上煌	9,700	159,080.00	0.08
543	000030	富奥股份	33,400	158,984.00	0.08
544	600055	万东医疗	15,400	158,928.00	0.08
545	300096	易联众	16,300	158,273.00	0.08
546	601886	江河集团	21,800	158,268.00	0.08
547	600571	信雅达	16,600	158,198.00	0.08
548	002522	浙江众成	25,700	157,798.00	0.08
549	600981	汇鸿集团	42,400	157,728.00	0.08
550	000801	四川九洲	29,000	156,600.00	0.08
551	600548	深高速	13,600	156,400.00	0.08
552	300386	飞天诚信	9,900	156,321.00	0.08
553	000155	川能动力	36,000	155,880.00	0.08
554	000927	一汽夏利	30,100	155,617.00	0.08
555	002664	长鹰信质	9,500	155,230.00	0.08
556	002462	嘉事堂	9,600	153,984.00	0.08
557	603609	禾丰牧业	13,000	153,790.00	0.08
558	600239	云南城投	53,107	153,479.23	0.08
559	002918	蒙娜丽莎	7,650	153,153.00	0.08
560	300373	扬杰科技	8,900	153,080.00	0.08
561	601330	绿色动力	14,400	153,072.00	0.08
562	600133	东湖高新	28,500	152,760.00	0.08
563	002061	浙江交科	26,000	152,620.00	0.08
564	002277	友阿股份	46,100	152,591.00	0.08
565	002309	中利集团	24,800	152,520.00	0.08
566	600894	广日股份	20,300	152,453.00	0.08
567	300441	鲍斯股份	15,640	152,333.60	0.08
568	300006	莱美药业	26,900	151,985.00	0.08
569	600449	宁夏建材	13,600	151,776.00	0.08

570	002206	海利得	40,450	151,687.50	0.08
571	002166	莱茵生物	18,720	151,632.00	0.08
572	603583	捷昌驱动	3,400	151,402.00	0.08
573	603613	国联股份	2,000	151,340.00	0.08
574	600677	*ST 航通	17,300	150,856.00	0.08
575	002307	北新路桥	25,540	150,686.00	0.08
576	002585	双星新材	32,820	150,643.80	0.08
577	002267	陕天然气	21,000	150,570.00	0.08
578	600391	航发科技	10,900	150,529.00	0.08
579	600636	三爱富	14,800	150,368.00	0.08
580	002564	天沃科技	32,900	150,353.00	0.08
581	600076	康欣新材	34,200	150,138.00	0.08
582	300726	宏达电子	5,700	150,024.00	0.08
583	300559	佳发教育	5,100	149,430.00	0.08
584	000957	中通客车	22,400	149,408.00	0.08
585	002425	凯撒文化	26,960	149,088.80	0.07
586	002768	国恩股份	6,400	149,056.00	0.07
587	603920	世运电路	7,800	148,902.00	0.07
588	603111	康尼机电	28,200	148,896.00	0.07
589	600975	新五丰	18,500	148,740.00	0.07
590	600351	亚宝药业	25,500	148,665.00	0.07
591	300039	上海凯宝	29,600	148,296.00	0.07
592	000811	冰轮环境	21,100	147,911.00	0.07
593	002240	威华股份	18,600	147,870.00	0.07
594	300224	正海磁材	15,500	147,870.00	0.07
595	300365	恒华科技	11,400	147,516.00	0.07
596	300409	道氏技术	10,900	147,477.00	0.07
597	002055	得润电子	13,700	147,138.00	0.07
598	300016	北陆药业	16,350	146,986.50	0.07
599	600963	岳阳林纸	33,100	146,633.00	0.07
600	300398	飞凯材料	9,760	145,912.00	0.07
601	300229	拓尔思	11,300	145,770.00	0.07
602	002224	三力士	23,700	145,755.00	0.07
603	300143	盈康生命	15,500	145,700.00	0.07
604	000687	华讯方舟	21,700	145,607.00	0.07
605	000620	新华联	35,900	145,395.00	0.07
606	300497	富祥股份	7,700	145,299.00	0.07
607	600626	申达股份	24,200	144,716.00	0.07
608	600389	江山股份	7,000	144,690.00	0.07
609	000928	中钢国际	29,700	144,045.00	0.07
610	002796	世嘉科技	4,000	144,000.00	0.07
611	603096	新经典	2,600	143,780.00	0.07
612	600590	泰豪科技	24,610	143,230.20	0.07

613	600096	云天化	27,000	143,100.00	0.07
614	002293	罗莱生活	15,750	143,010.00	0.07
615	300215	电科院	21,500	142,545.00	0.07
616	600090	同济堂	34,100	142,538.00	0.07
617	603367	辰欣药业	8,600	142,330.00	0.07
618	300263	隆华科技	26,000	142,220.00	0.07
619	002755	奥赛康	8,800	142,208.00	0.07
620	600106	重庆路桥	45,692	142,102.12	0.07
621	300158	振东制药	29,300	141,812.00	0.07
622	300110	华仁药业	33,560	141,623.20	0.07
623	600825	新华传媒	24,700	141,531.00	0.07
624	601908	京运通	47,100	141,300.00	0.07
625	000950	重药控股	24,500	141,120.00	0.07
626	000913	钱江摩托	12,800	140,928.00	0.07
627	603636	南威软件	12,399	140,480.67	0.07
628	002539	云图控股	28,600	140,426.00	0.07
629	600172	黄河旋风	48,040	139,796.40	0.07
630	002614	奥佳华	13,200	139,656.00	0.07
631	600075	新疆天业	27,600	139,656.00	0.07
632	000552	靖远煤电	54,100	139,578.00	0.07
633	002327	富安娜	20,100	139,494.00	0.07
634	000662	天夏智慧	25,900	139,083.00	0.07
635	300633	开立医疗	5,800	138,620.00	0.07
636	002308	威创股份	30,000	138,600.00	0.07
637	002355	兴民智通	20,500	138,580.00	0.07
638	600569	安阳钢铁	54,300	138,465.00	0.07
639	002256	兆新股份	53,400	138,306.00	0.07
640	002928	华夏航空	11,350	138,243.00	0.07
641	000989	九芝堂	16,500	137,775.00	0.07
642	300065	海兰信	11,300	137,747.00	0.07
643	300788	中信出版	2,700	137,700.00	0.07
644	600211	西藏药业	4,300	137,557.00	0.07
645	601366	利群股份	24,400	137,372.00	0.07
646	002619	艾格拉斯	43,580	137,277.00	0.07
647	002283	天润曲轴	37,300	137,264.00	0.07
648	600710	苏美达	24,700	137,085.00	0.07
649	002197	证通电子	17,100	136,800.00	0.07
650	300066	三川智慧	29,500	136,585.00	0.07
651	601952	苏垦农发	19,510	136,374.90	0.07
652	300219	鸿利智汇	20,100	136,278.00	0.07
653	600184	光电股份	12,000	136,080.00	0.07
654	300755	华致酒行	5,980	135,506.80	0.07
655	600136	当代明诚	11,000	135,300.00	0.07

656	600662	强生控股	29,800	135,292.00	0.07
657	000550	江铃汽车	9,800	135,240.00	0.07
658	300783	三只松鼠	2,100	135,177.00	0.07
659	600773	西藏城投	23,300	135,140.00	0.07
660	002721	金一文化	23,700	135,090.00	0.07
661	002478	常宝股份	22,700	134,384.00	0.07
662	603429	集友股份	3,800	134,140.00	0.07
663	000525	红太阳	13,800	134,136.00	0.07
664	603337	杰克股份	6,395	134,039.20	0.07
665	600458	时代新材	19,000	133,950.00	0.07
666	300776	帝尔激光	900	133,857.00	0.07
667	300205	天喻信息	12,200	133,712.00	0.07
668	002228	合兴包装	33,200	133,464.00	0.07
669	601116	三江购物	10,300	132,973.00	0.07
670	002245	澳洋顺昌	32,500	132,925.00	0.07
671	300506	名家汇	15,510	132,920.70	0.07
672	002322	理工环科	11,200	132,720.00	0.07
673	300388	国祯环保	12,600	132,678.00	0.07
674	002638	勤上股份	35,900	132,471.00	0.07
675	002443	金洲管道	19,700	132,384.00	0.07
676	300302	同有科技	10,800	132,192.00	0.07
677	002344	海宁皮城	30,300	132,108.00	0.07
678	300191	潜能恒信	6,100	131,943.00	0.07
679	002239	奥特佳	73,980	131,684.40	0.07
680	300299	富春股份	26,895	131,516.55	0.07
681	300378	鼎捷软件	8,800	131,296.00	0.07
682	600523	贵航股份	9,580	131,246.00	0.07
683	300176	鸿特科技	14,640	131,174.40	0.07
684	600255	梦舟股份	83,600	130,416.00	0.07
685	002726	龙大肉食	18,571	129,997.00	0.07
686	603363	傲农生物	8,200	129,888.00	0.07
687	000797	中国武夷	37,129	129,580.21	0.07
688	603313	梦百合	6,120	129,193.20	0.06
689	603305	旭升股份	3,800	129,010.00	0.06
690	600581	八一钢铁	36,200	128,872.00	0.06
691	601107	四川成渝	30,600	128,826.00	0.06
692	002685	华东重机	19,000	128,820.00	0.06
693	600508	上海能源	13,700	128,643.00	0.06
694	600800	天津磁卡	23,200	128,528.00	0.06
695	600481	双良节能	38,700	128,484.00	0.06
696	600810	神马股份	16,280	128,449.20	0.06
697	601126	四方股份	23,100	127,974.00	0.06
698	002542	中化岩土	34,200	127,908.00	0.06

699	600855	航天长峰	10,400	127,816.00	0.06
700	603803	瑞斯康达	9,900	127,710.00	0.06
701	601515	东风股份	18,900	127,575.00	0.06
702	600897	厦门空港	5,700	127,338.00	0.06
703	000584	哈工智能	20,300	127,281.00	0.06
704	300208	青岛中程	17,700	127,086.00	0.06
705	002219	恒康医疗	52,900	126,431.00	0.06
706	300081	恒信东方	12,500	126,375.00	0.06
707	600676	交运股份	29,190	126,100.80	0.06
708	000065	北方国际	14,575	126,073.75	0.06
709	300252	金信诺	13,750	125,812.50	0.06
710	600322	天房发展	41,900	125,700.00	0.06
711	002029	七匹狼	21,400	125,190.00	0.06
712	300336	新文化	30,500	124,745.00	0.06
713	300761	立华股份	2,100	124,740.00	0.06
714	000822	山东海化	25,400	124,714.00	0.06
715	600715	文投控股	35,100	124,605.00	0.06
716	300684	中石科技	4,800	124,560.00	0.06
717	300423	鲁亿通	9,400	124,456.00	0.06
718	000055	方大集团	25,750	124,372.50	0.06
719	002913	奥士康	2,100	124,299.00	0.06
720	300368	汇金股份	15,100	124,122.00	0.06
721	600995	文山电力	15,900	124,020.00	0.06
722	603979	金诚信	13,862	123,787.66	0.06
723	300467	迅游科技	6,400	123,520.00	0.06
724	000925	众合科技	18,420	123,414.00	0.06
725	002582	好想你	14,700	123,333.00	0.06
726	601858	中国科传	11,200	122,752.00	0.06
727	002621	美吉姆	11,200	122,640.00	0.06
728	000665	湖北广电	22,860	122,301.00	0.06
729	002279	久其软件	20,130	122,189.10	0.06
730	002756	永兴材料	6,800	122,060.00	0.06
731	600798	宁波海运	34,200	121,752.00	0.06
732	002930	宏川智慧	8,060	121,061.20	0.06
733	600230	沧州大化	11,680	120,654.40	0.06
734	600227	圣济堂	48,000	120,480.00	0.06
735	002060	粤水电	39,700	120,291.00	0.06
736	300255	常山药业	22,100	120,224.00	0.06
737	600382	广东明珠	17,190	120,158.10	0.06
738	300021	大禹节水	22,650	120,045.00	0.06
739	300276	三丰智能	15,100	120,045.00	0.06
740	600480	凌云股份	15,590	119,731.20	0.06
741	300359	全通教育	21,000	119,490.00	0.06

742	000150	宜华健康	24,944	119,481.76	0.06
743	002137	麦达数字	16,400	119,392.00	0.06
744	002393	力生制药	4,360	119,158.80	0.06
745	300638	广和通	1,900	119,130.00	0.06
746	002955	鸿合科技	2,000	119,020.00	0.06
747	600318	新力金融	17,000	119,000.00	0.06
748	002636	金安国纪	13,800	118,266.00	0.06
749	603267	鸿远电子	2,300	118,013.00	0.06
750	002314	南山控股	38,400	117,888.00	0.06
751	600229	城市传媒	16,600	117,860.00	0.06
752	600603	广汇物流	23,800	117,810.00	0.06
753	600691	阳煤化工	56,100	117,810.00	0.06
754	000889	中嘉博创	12,600	117,810.00	0.06
755	002204	大连重工	36,500	117,165.00	0.06
756	002650	加加食品	32,700	117,066.00	0.06
757	002518	科士达	10,970	117,049.90	0.06
758	002034	旺能环境	7,900	116,999.00	0.06
759	000038	深大通	9,860	116,841.00	0.06
760	002433	太安堂	25,400	116,586.00	0.06
761	000532	华金资本	9,800	116,522.00	0.06
762	002929	润建股份	4,200	116,340.00	0.06
763	000892	欢瑞世纪	23,200	116,232.00	0.06
764	603169	兰石重装	19,900	116,216.00	0.06
765	000639	西王食品	25,560	115,786.80	0.06
766	002712	思美传媒	13,800	115,782.00	0.06
767	603458	勘设股份	6,065	115,780.85	0.06
768	300107	建新股份	15,600	115,752.00	0.06
769	300209	天泽信息	8,100	115,587.00	0.06
770	002556	辉隆股份	20,300	115,304.00	0.06
771	300785	值得买	800	115,216.00	0.06
772	000544	中原环保	18,400	115,184.00	0.06
773	300504	天邑股份	5,100	114,954.00	0.06
774	000615	京汉股份	25,900	114,737.00	0.06
775	603387	基蛋生物	4,960	114,328.00	0.06
776	600929	湖南盐业	17,400	114,144.00	0.06
777	000657	中钨高新	16,660	114,121.00	0.06
778	603063	禾望电气	12,200	113,948.00	0.06
779	002121	科陆电子	26,600	113,848.00	0.06
780	603359	东珠生态	7,580	113,624.20	0.06
781	603298	杭叉集团	8,800	113,344.00	0.06
782	603869	新智认知	9,500	113,240.00	0.06
783	603357	设计总院	10,740	112,984.80	0.06
784	002581	未名医药	15,600	112,944.00	0.06

785	600933	爱柯迪	8,100	112,914.00	0.06
786	601606	长城军工	10,300	112,682.00	0.06
787	300248	新开普	13,691	112,403.11	0.06
788	002901	大博医疗	1,900	112,271.00	0.06
789	000815	美利云	16,500	111,705.00	0.06
790	300343	联创股份	38,895	111,628.65	0.06
791	601101	昊华能源	22,700	111,003.00	0.06
792	600054	黄山旅游	12,100	110,957.00	0.06
793	002751	易尚展示	4,400	110,704.00	0.06
794	300213	佳讯飞鸿	16,900	110,526.00	0.06
795	002464	众应互联	17,316	110,476.08	0.06
796	002148	北纬科技	21,400	110,424.00	0.06
797	002094	青岛金王	22,960	110,208.00	0.06
798	002947	恒铭达	1,700	110,092.00	0.06
799	300148	天舟文化	27,930	110,044.20	0.06
800	002229	鸿博股份	16,500	109,890.00	0.06
801	603826	坤彩科技	6,700	109,813.00	0.06
802	300424	航新科技	6,855	109,748.55	0.06
803	002741	光华科技	8,800	109,648.00	0.06
804	600035	楚天高速	32,100	109,461.00	0.05
805	603727	博迈科	5,600	108,752.00	0.05
806	603980	吉华集团	13,180	108,735.00	0.05
807	600758	红阳能源	25,000	108,500.00	0.05
808	600231	凌钢股份	39,240	108,302.40	0.05
809	300662	科锐国际	3,400	108,086.00	0.05
810	300237	美晨生态	41,260	107,688.60	0.05
811	002840	华统股份	6,600	107,580.00	0.05
812	600550	保变电气	34,800	107,184.00	0.05
813	600684	珠江实业	28,260	107,105.40	0.05
814	002630	华西能源	44,660	106,737.40	0.05
815	603595	东尼电子	4,128	106,543.68	0.05
816	002284	亚太股份	20,900	106,172.00	0.05
817	601789	宁波建工	27,700	105,537.00	0.05
818	002218	拓日新能	35,100	105,300.00	0.05
819	000711	京蓝科技	19,340	105,209.60	0.05
820	600278	东方创业	9,900	105,039.00	0.05
821	002461	珠江啤酒	14,700	104,958.00	0.05
822	002609	捷顺科技	12,200	104,798.00	0.05
823	603590	康辰药业	3,000	104,760.00	0.05
824	603959	百利科技	10,360	104,636.00	0.05
825	002519	银河电子	26,680	104,585.60	0.05
826	000561	烽火电子	14,300	104,390.00	0.05
827	603218	日月股份	5,020	104,265.40	0.05

828	002335	科华恒盛	6,400	104,128.00	0.05
829	002562	兄弟科技	21,320	104,041.60	0.05
830	000058	深赛格	14,100	103,635.00	0.05
831	002345	潮宏基	25,700	103,571.00	0.05
832	002833	弘亚数控	2,600	103,402.00	0.05
833	000885	城发环境	9,400	103,306.00	0.05
834	603220	中贝通信	4,800	103,152.00	0.05
835	300634	彩讯股份	5,700	102,942.00	0.05
836	600467	好当家	41,500	102,920.00	0.05
837	600069	银鸽投资	38,400	102,528.00	0.05
838	603348	文灿股份	4,200	102,228.00	0.05
839	300332	天壕环境	25,000	101,750.00	0.05
840	603299	苏盐井神	14,700	101,577.00	0.05
841	600242	中昌数据	12,900	101,523.00	0.05
842	002631	德尔未来	12,600	101,430.00	0.05
843	600180	瑞茂通	14,500	101,210.00	0.05
844	600686	金龙汽车	14,400	101,088.00	0.05
845	603801	志邦家居	4,320	100,612.80	0.05
846	002451	摩恩电气	10,400	100,568.00	0.05
847	300765	新诺威	2,800	99,960.00	0.05
848	600533	栖霞建设	29,800	99,830.00	0.05
849	600734	实达集团	14,700	99,813.00	0.05
850	000545	金浦钛业	32,700	99,408.00	0.05
851	300393	中来股份	6,860	99,401.40	0.05
852	603612	索通发展	8,020	99,367.80	0.05
853	000821	京山轻机	15,300	99,297.00	0.05
854	603919	金徽酒	5,600	99,176.00	0.05
855	603666	亿嘉和	1,400	99,120.00	0.05
856	300751	迈为股份	700	99,015.00	0.05
857	600568	中珠医疗	56,500	98,875.00	0.05
858	300364	中文在线	24,056	98,870.16	0.05
859	000498	山东路桥	21,100	98,748.00	0.05
860	002016	世荣兆业	11,400	98,724.00	0.05
861	601015	陕西黑猫	30,760	98,432.00	0.05
862	002141	贤丰控股	26,800	98,356.00	0.05
863	300309	吉艾科技	20,880	98,344.80	0.05
864	002370	亚太药业	15,200	97,736.00	0.05
865	300288	朗玛信息	8,000	97,520.00	0.05
866	002776	柏堡龙	12,650	97,405.00	0.05
867	300613	富瀚微	600	97,308.00	0.05
868	600012	皖通高速	16,500	97,020.00	0.05
869	002246	北化股份	12,900	97,008.00	0.05
870	603876	鼎胜新材	6,100	96,746.00	0.05

871	002538	司尔特	20,300	96,628.00	0.05
872	603587	地素时尚	3,800	96,444.00	0.05
873	603898	好莱客	5,875	95,997.50	0.05
874	300531	优博讯	5,900	95,934.00	0.05
875	000557	西部创业	27,600	95,220.00	0.05
876	000576	广东甘化	12,500	95,125.00	0.05
877	300317	珈伟新能	19,793	95,006.40	0.05
878	000019	深粮控股	15,600	94,848.00	0.05
879	000791	甘肃电投	25,740	94,723.20	0.05
880	300624	万兴科技	1,500	94,650.00	0.05
881	300064	豫金刚石	28,500	94,050.00	0.05
882	601566	九牧王	8,200	93,808.00	0.05
883	603808	歌力思	6,300	93,681.00	0.05
884	002516	旷达科技	34,800	93,612.00	0.05
885	600650	锦江投资	9,200	93,380.00	0.05
886	000905	厦门港务	12,500	93,375.00	0.05
887	600619	海立股份	11,300	93,225.00	0.05
888	000881	中广核技	13,500	92,745.00	0.05
889	002378	章源钨业	17,500	92,400.00	0.05
890	600876	洛阳玻璃	5,700	91,941.00	0.05
891	300262	巴安水务	18,950	91,907.50	0.05
892	000923	河钢资源	6,200	91,574.00	0.05
893	002646	青青稞酒	8,500	91,035.00	0.05
894	601020	华钰矿业	9,900	90,387.00	0.05
895	002305	南国置业	41,000	90,200.00	0.05
896	603618	杭电股份	16,400	90,200.00	0.05
897	002158	汉钟精机	10,100	90,092.00	0.05
898	300439	美康生物	6,600	89,694.00	0.05
899	002101	广东鸿图	12,550	89,607.00	0.05
900	300771	智莱科技	1,400	89,222.00	0.04
901	600638	新黄浦	12,700	89,154.00	0.04
902	300682	朗新科技	3,900	88,257.00	0.04
903	300723	一品红	2,300	88,228.00	0.04
904	603713	密尔克卫	2,200	88,110.00	0.04
905	603318	派思股份	7,600	87,628.00	0.04
906	300520	科大国创	4,740	87,547.80	0.04
907	300140	中环装备	8,100	86,832.00	0.04
908	603728	鸣志电器	7,834	86,800.72	0.04
909	300178	腾邦国际	17,500	86,800.00	0.04
910	603648	畅联股份	8,700	86,652.00	0.04
911	002933	新兴装备	2,200	85,800.00	0.04
912	600295	鄂尔多斯	9,500	85,690.00	0.04
913	300533	冰川网络	1,900	85,177.00	0.04

914	300171	东 富 龙	11,900	84,371.00	0.04
915	603105	芯能科技	11,800	84,370.00	0.04
916	002232	启明信息	9,700	84,293.00	0.04
917	600310	桂东电力	19,600	84,084.00	0.04
918	000965	天保基建	26,200	83,316.00	0.04
919	000517	荣安地产	30,100	83,076.00	0.04
920	603466	风 语 筑	5,600	82,992.00	0.04
921	002068	黑猫股份	17,200	82,732.00	0.04
922	300307	慈星股份	18,900	82,404.00	0.04
923	000567	海德股份	9,100	81,991.00	0.04
924	603896	寿 仙 谷	2,700	81,594.00	0.04
925	603626	科森科技	7,840	81,457.60	0.04
926	002534	杭锅股份	10,500	81,060.00	0.04
927	603579	荣泰健康	2,600	80,860.00	0.04
928	600618	氯碱化工	10,600	78,334.00	0.04
929	300673	佩蒂股份	2,800	78,092.00	0.04
930	300011	鼎汉技术	13,200	78,012.00	0.04
931	002590	万安科技	11,300	77,970.00	0.04
932	603421	鼎信通讯	4,500	77,940.00	0.04
933	000626	远大控股	10,300	77,456.00	0.04
934	001896	豫能控股	21,700	77,252.00	0.04
935	300775	三角防务	2,300	76,751.00	0.04
936	300768	迪普科技	2,100	76,587.00	0.04
937	603777	来 伊 份	6,480	76,269.60	0.04
938	600207	安彩高科	16,300	76,121.00	0.04
939	300109	新 开 源	4,618	75,596.66	0.04
940	000514	渝 开 发	16,000	75,360.00	0.04
941	002662	京威股份	28,400	74,976.00	0.04
942	603839	安正时尚	5,720	74,932.00	0.04
943	002852	道 道 全	5,540	74,679.20	0.04
944	603773	沃格光电	2,200	74,118.00	0.04
945	300740	御 家 汇	7,800	74,022.00	0.04
946	002769	普 路 通	8,800	74,008.00	0.04
947	300410	正业科技	9,021	73,430.94	0.04
948	603327	福蓉科技	2,500	72,975.00	0.04
949	300278	华 昌 达	17,000	72,930.00	0.04
950	000056	皇庭国际	17,600	72,864.00	0.04
951	600738	兰州民百	14,700	72,618.00	0.04
952	600290	ST 华 仪	25,200	71,568.00	0.04
953	002485	希 努 尔	10,300	70,967.00	0.04
954	002346	柘中股份	6,300	70,812.00	0.04
955	000011	深物业 A	7,500	70,575.00	0.04
956	002895	川恒股份	5,700	70,566.00	0.04

957	002651	利君股份	14,500	70,325.00	0.04
958	002435	长江健康	17,500	70,000.00	0.04
959	600283	钱江水利	6,659	69,653.14	0.03
960	002759	天际股份	7,600	69,160.00	0.03
961	300766	每日互动	2,100	68,901.00	0.03
962	603103	横店影视	3,620	68,092.20	0.03
963	603180	金牌厨柜	1,000	66,780.00	0.03
964	000838	财信发展	20,800	66,768.00	0.03
965	002656	ST 摩 登	16,820	66,102.60	0.03
966	603915	国茂股份	4,400	65,032.00	0.03
967	300777	中简科技	2,100	64,848.00	0.03
968	002782	可 立 克	6,100	64,721.00	0.03
969	603533	掌阅科技	3,800	64,372.00	0.03
970	603081	大丰实业	3,900	63,609.00	0.03
971	603185	上机数控	2,460	61,992.00	0.03
972	300061	旗天科技	9,600	61,248.00	0.03
973	603693	江苏新能	5,900	60,062.00	0.03
974	603997	继峰股份	7,300	58,984.00	0.03
975	603557	起步股份	6,800	56,236.00	0.03
976	601619	嘉泽新能	14,700	56,154.00	0.03
977	300674	宇信科技	2,100	55,335.00	0.03
978	603603	博天环境	6,000	55,080.00	0.03
979	002377	国创高新	13,000	53,820.00	0.03
980	002906	华阳集团	4,500	53,460.00	0.03
981	603619	中曼石油	3,800	52,972.00	0.03
982	603555	贵 人 鸟	8,900	52,510.00	0.03
983	300100	双林股份	8,600	51,428.00	0.03
984	603711	香 飘 飘	2,000	51,200.00	0.03
985	300428	四通新材	3,600	50,616.00	0.03
986	603098	森特股份	4,560	50,524.80	0.03
987	002950	奥美医疗	2,400	50,040.00	0.03
988	603900	莱绅通灵	4,880	46,116.00	0.02
989	603279	景津环保	2,100	44,856.00	0.02
990	002911	佛燃股份	2,900	44,718.00	0.02
991	603013	亚普股份	2,900	44,544.00	0.02
992	603058	永吉股份	6,000	44,520.00	0.02
993	603733	仙鹤股份	3,100	44,206.00	0.02
994	002907	华森制药	2,400	39,984.00	0.02
995	002951	金时科技	2,300	39,790.00	0.02
996	603680	今创集团	3,790	39,453.90	0.02
997	603956	威 派 格	2,200	36,498.00	0.02
998	603687	大 胜 达	2,500	36,175.00	0.02
999	603848	好 太 太	2,400	33,288.00	0.02

1,000	603676	卫 信 康	3,000	31,830.00	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	688111	金山办公	6,282	808,053.66	0.41
2	688011	新光光电	8,807	361,527.35	0.18
3	688030	山石网科	5,967	226,149.30	0.11
4	688368	晶丰明源	1,704	128,021.52	0.06
5	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.04
6	688181	八亿时空	1,794	78,900.12	0.04
7	002972	科 安 达	1,075	21,532.25	0.01
8	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
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	601512	中新集团	98	1,362.20	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	300347	泰格医药	6,058,279.48	5.01
2	300616	尚品宅配	3,759,915.32	3.11
3	300226	上海钢联	3,637,189.00	3.01
4	300014	亿纬锂能	3,541,942.00	2.93
5	300628	亿联网络	3,298,614.00	2.73
6	300012	华测检测	3,144,561.00	2.60
7	300529	健帆生物	2,851,647.00	2.36
8	300285	国瓷材料	2,833,943.10	2.34
9	002138	顺络电子	2,701,686.50	2.24
10	300271	华宇软件	2,644,357.00	2.19
11	300567	精测电子	2,568,239.00	2.12
12	002124	天邦股份	2,541,735.02	2.10
13	002185	华天科技	2,461,256.66	2.04
14	300630	普利制药	2,349,762.45	1.94
15	300170	汉得信息	2,278,025.00	1.88
16	300474	景 嘉 微	2,269,676.00	1.88
17	002396	星网锐捷	2,204,037.83	1.82
18	300188	美亚柏科	2,173,735.20	1.80

19	000735	罗牛山	2,123,846.00	1.76
20	300098	高新兴	2,101,711.00	1.74

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	300347	泰格医药	6,836,561.54	5.66
2	300014	亿纬锂能	4,765,679.16	3.94
3	300012	华测检测	4,115,921.00	3.41
4	300628	亿联网络	3,917,473.62	3.24
5	300616	尚品宅配	3,695,886.40	3.06
6	300285	国瓷材料	3,627,092.00	3.00
7	300226	上海钢联	3,578,721.86	2.96
8	300529	健帆生物	3,263,337.27	2.70
9	002138	顺络电子	2,676,125.00	2.21
10	000977	浪潮信息	2,560,393.00	2.12
11	300567	精测电子	2,514,542.29	2.08
12	300271	华宇软件	2,470,020.00	2.04
13	002185	华天科技	2,379,667.00	1.97
14	002124	天邦股份	2,339,382.00	1.94
15	300630	普利制药	2,256,459.14	1.87
16	002157	正邦科技	2,233,837.00	1.85
17	688009	中国通号	2,224,564.26	1.84
18	300170	汉得信息	2,157,052.00	1.78
19	300180	华峰超纤	2,125,789.50	1.76
20	300474	景嘉微	2,124,484.00	1.76

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	696,459,553.97
卖出股票收入（成交）总额	655,179,594.48

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

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）	80,600.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,600.00	0.04

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	128092	唐人转债	350	35,000.00	0.02
2	128089	麦米转债	134	13,400.00	0.01
3	113558	日月转债	130	13,000.00	0.01
4	128090	汽模转 2	112	11,200.00	0.01
5	113554	仙鹤转债	80	8,000.00	0.00

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/	合约市值	公允价值变	风险说明
----	----	--------	------	-------	------

		卖)	(元)	动(元)	
IC2001	IC2001	2	2,106,720.00	45,650.00	-
IC2002	IC2002	2	2,099,840.00	16,000.00	-
IC2003	IC2003	2	2,092,640.00	12,680.00	-
公允价值变动总额合计(元)					74,330.00
股指期货投资本期收益(元)					1,260,300.98
股指期货投资本期公允价值变动(元)					95,450.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	912,103.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,794.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	914,897.52

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	688111	金山办公	808,053.66	0.41	科创板新股锁定期
2	688011	新光光电	361,527.35	0.18	科创板新股锁定期
3	688030	山石网科	226,149.30	0.11	科创板新股锁定期
4	688368	晶丰明源	128,021.52	0.06	科创板新股锁定期
5	688081	兴图新科	88,946.13	0.04	新股未上市

§ 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,507	61,879.74	61,046,000.00	21.89%	217,846,000.00	78.11%

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	中国国际金融股份有限公司	14,130,300.00	5.07%
2	江苏省玖号职业年金计划-建设银行	6,572,800.00	2.36%
3	湖南省(柒号)职业年金计划-交通银行	6,544,900.00	2.35%
4	颜飞	6,413,300.00	2.30%

5	广发证券股份有限公司	5,002,600.00	1.79%
6	深圳霖润投资控股有限公司-霖润价值一号私募投资基金	4,957,300.00	1.78%
7	徐洁静	4,563,600.00	1.64%
8	招商证券股份有限公司	4,297,200.00	1.54%
9	杨肖	4,250,600.00	1.52%
10	中国银河证券股份有限公司	4,065,200.00	1.46%

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(2016年9月29日)基金份额总额	587,892,000.00
本报告期期初基金份额总额	227,892,000.00
本报告期基金总申购份额	1,242,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	1,191,000,000.00
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	278,892,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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。

自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

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 4 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 55,000.00 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	
万联证券	1	1,063,065,431.88	79.42%	106,319.92	79.42%	-
华泰证券	4	230,138,595.00	17.19%	23,014.85	17.19%	-
国信证券	1	45,372,024.37	3.39%	4,537.68	3.39%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：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
万联证券	53,953.36	17.03%	-	-	-	-
华泰证券	26,134.40	8.25%	-	-	-	-
国信证券	236,712.10	74.72%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金增加国都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
2	南方基金关于旗下部分基金增加国盛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	2019-04-08
3	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金增加中金公司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	2019-04-15
4	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
5	关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-07-13

	资基金变更基金经理的公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
6	南方基金关于旗下部分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	2019-10-21
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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

§ 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南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 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>