

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54

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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
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	83
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	83
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	84
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	84
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12 投资组合报告附注	84
§ 9 基金份额持有人信息	85
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2 期末上市基金前十名持有人	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
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	87
§ 10 开放式基金份额变动	87
§ 11 重大事件揭示	88
11.1 基金份额持有人大会决议	88
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	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4 基金投资策略的改变	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	88
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	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件	92
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	96
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	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	96
§ 13 备查文件目录	96
13.1 备查文件目录	96
13.2 存放地点	96
13.3 查阅方式	96

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金		
基金简称	华宝中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
基金主代码	162413		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	57,366,238.99 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 6 月 16 日		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金的场内简称	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金的份额总额	1,734,179.00 份	1,734,179.00 份	53,897,880.99 份

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。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比

	较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。		
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金的风险收益特征	华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。	华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	HUANG Xiaoyi Helen (黄小慧)	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		孔祥清	田国立

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	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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

金额单位：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	-5,759,941.35	-11,514,960.51	-7,585,252.22
本期利润	11,127,077.44	-22,718,230.72	-13,338,496.79
加权平均基金份额本期利润	0.1879	-0.3617	-0.1135
本期加权平均净值利润率	23.38%	-43.49%	-14.90%
本期基金份额净值增长率	27.28%	-35.99%	-14.42%
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	-96,177,604.95	-108,584,959.73	-99,663,522.64
期末可供分配基金份额利润	-1.6766	-1.8043	-0.9223
期末基金资产净值	47,140,075.82	40,186,333.58	71,923,861.62
期末基金份额净值	0.8217	0.6678	0.6656
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	-65.62%	-72.99%	-57.79%

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

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

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用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

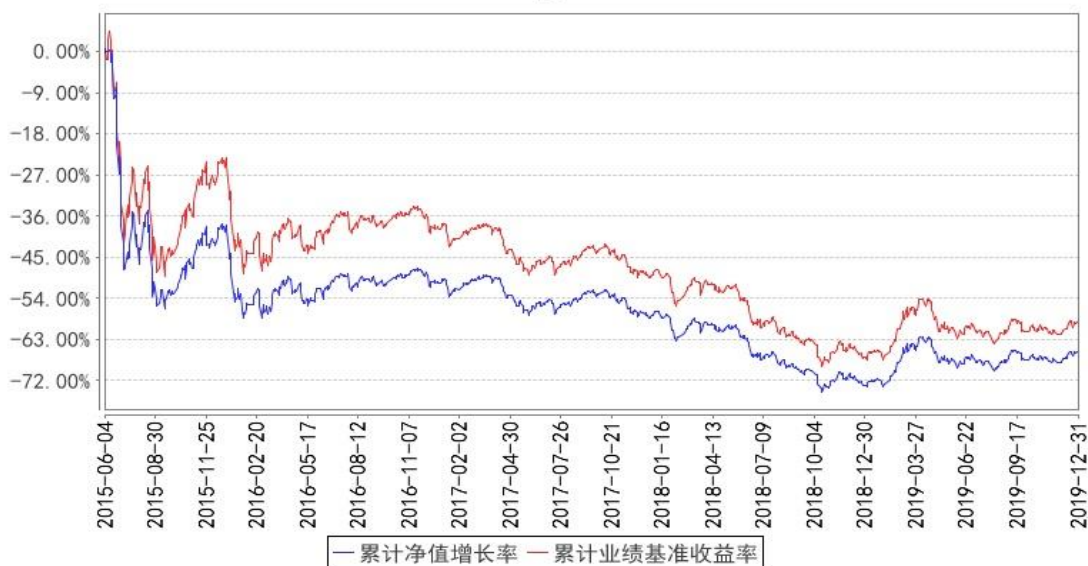
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.96%	0.94%	6.09%	0.96%	-0.13%	-0.02%
过去六个月	5.33%	1.10%	4.43%	1.12%	0.90%	-0.02%
过去一年	27.28%	1.46%	24.44%	1.49%	2.84%	-0.03%
过去三年	-30.28%	1.32%	-32.76%	1.34%	2.48%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-65.62%	1.81%	-58.89%	1.83%	-6.73%	-0.02%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

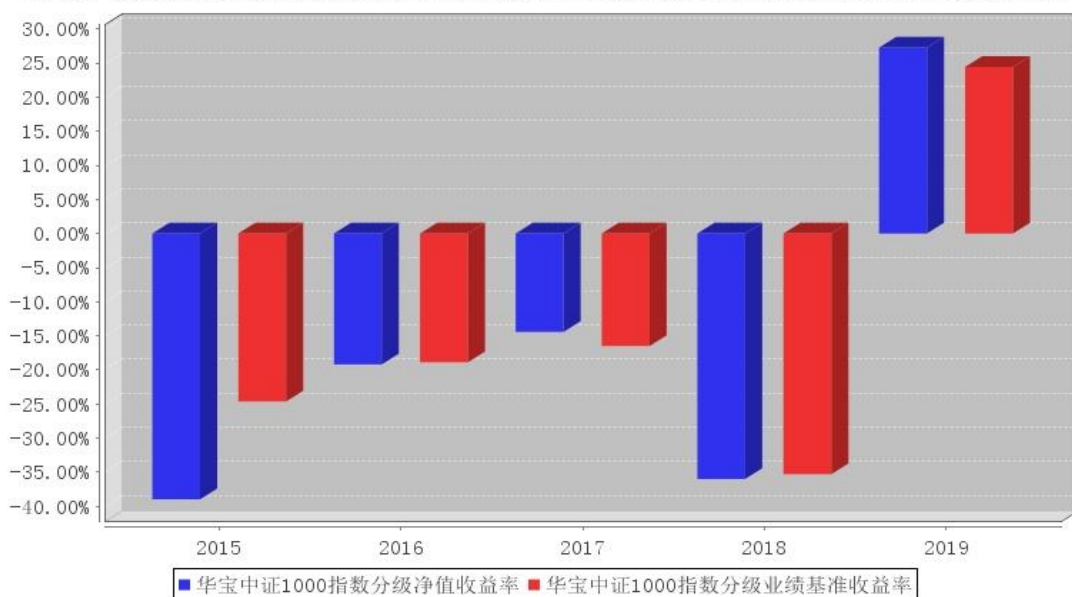
华宝中证1000指数分级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 4 日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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

华宝中证1000指数分级基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效,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

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2019 年 12 月 31 日），正在管理运作的证券投资基金分别为：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝多策略增长开放式证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝收益增长混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数证券投资基金 (LOF)、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证

券投资基金、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝大健康混合型证券投资基金、华宝中短债债券型发起式证券投资基金、华宝宝裕纯债债券型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝宝盛纯债债券型证券投资基金、华宝消费升级混合型证券投资基金、华宝宝怡纯债债券型证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝政策性金融债债券型证券投资基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金、华宝宝润纯债债券型证券投资基金、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF)。

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		
丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	10 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018

					<p>年 4 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2018 年 8 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。</p>
张奇	<p>本基金基金经理助理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证银行 ETF（场内简称“银行 ETF”）、华宝银行 ETF 联接基金经理助理</p>	2017 年 4 月 6 日	-	9 年	<p>本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2015 年 5 月至 2018 年 11 月兼任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2015 年 5 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2017 年 4 月至 2019 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝中证军工交易型开放式指数证券</p>

					<p>投资基金基金经理助理。2017 年 4 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理助理。2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理助理。2019 年 1 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝基金管理有限公司华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，中证 1000 指数分级证券投资基金在短期内出现过股票投资低于基金资产净值 90%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

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

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告

和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结

果未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

2018 年全年 A 股市场呈现振荡走低的格局，受民企信用债违约、股票质押风险暴露、中美贸易战等因素下，中小盘股票相对于大市值股票的跌幅更多。中证 1000 指数作为 A 股市场小盘股的典型代表，其成分股中的民营企业占比较高，受宏观经济增速放缓预期加之贸易战带来的未来进出口的悲观预期，加之部分上市公司的信用问题暴露、大股东股权质押比例高等问题产生连锁影响，使得市场对于整个中小市值公司产生悲观预期的叠加，2018 年该类上市公司的估值水平在持续向下修正。

本报告期为本基金的正常运作期，在实际操作中，我们遵守基金合同，按照既定的投资策略达到投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 27.28%，同期业绩比较基准收益率为 24.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，中国宏观经济或面临“增速换挡”，但已出现一些触底企稳迹象。A 股市场结构性行情或仍将延续，流动性宽松大趋势、“十四五”规划展望、对外开放加速为股票市场、相关产业带来估值提升机会。在国家重视、居民配置、机构配置、全球配置等“四重奏”指引下，真正属于中国的权益时代有望正式开启。中证 1000 指数表征的小盘股在 17、18、19 年跌幅相比大市值股票明显要多，在经历了 15 年以来小盘股的估值逐渐回归正常并向着大中市值估值水平逐渐收敛，年末中证 1000 指数的 PE (TTM) 估值 38 倍左右，在历史纵向上看处于较低的位置。同时从历史回顾来看，大盘股和中小盘股的相对强弱具有周期性，2019 年 11 月证监会就修改上市公司再融资政策征求意见，新规提升再融资的便捷性和制度包容性，提高股权融资比重，优化现行

再融资发行条件，降低硬性门槛。在并购重组及再融资市场化周期下，小盘股的外延式并购又重新开始被提及，其估值水平有望随着市场风格及风险偏好而提升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司合规审计部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和合规审计部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计工作。合规审计部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会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。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[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》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《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》、《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》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金基金合同生效于 2015 年 6 月 4 日，截至 2019 年 12 月 31 日，本基金基金资产净值已连续超过六十个工作日低于 5000 万元。根据相关规定，基金管理人已拟定解决方案，目前已通过证监会备案，基金管理人将尽快付诸实施，并及时履行信息披露义务。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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	安永华明（2020）审字第 61471289_B02 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	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。

	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>其他信息</p>	<p>华宝中证 1000 指数分级证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估华宝中证 1000 指数分级证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华宝中证 1000 指数分级证券投资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>（1）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>（2）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>（3）评价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>(4) 对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，就可能对导致对华宝中证 1000 指数分级证券投资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华宝中证 1000 指数分级证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	徐艳	印艳萍
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2020 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

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	2,706,235.67	2,632,693.09
结算备付金		-	-
存出保证金		1,145.30	818.24
交易性金融资产	7.4.7.2	44,173,304.38	37,797,465.57
其中：股票投资		44,169,009.82	37,797,465.57
基金投资		-	-
债券投资		4,294.56	-
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		525,551.83	30,510.65
应收利息	7.4.7.5	597.65	570.91
应收股利		-	-

应收申购款		12,079.36	26,802.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		47,418,914.19	40,488,861.34
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		-	-
应付赎回款		97,574.29	72,229.05
应付管理人报酬		39,237.02	35,633.00
应付托管费		8,632.16	7,839.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	13,140.25	66,562.70
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	120,254.65	120,263.75
负债合计		278,838.37	302,527.76
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	137,101,021.14	148,771,293.31
未分配利润	7.4.7.10	-89,960,945.32	-108,584,959.73
所有者权益合计		47,140,075.82	40,186,333.58
负债和所有者权益总计		47,418,914.19	40,488,861.34

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 57,366,238.99 份，其中 1000A 基金份额总额为 1,734,179.00 份，基金份额净值 1.0027 元；1000B 基金份额总额为 1,734,179.00 份，基金份额净值 0.6407 元；华宝中证 1000 指数分级基金份额总额为 53,897,880.99 份，基金份额净值 0.8217 元。

7.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

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	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		12,092,764.70	-21,689,726.15

1. 利息收入		23,189.04	24,981.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,180.39	24,981.14
债券利息收入		8.65	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,841,219.94	-10,525,462.99
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,310,539.05	-10,984,857.80
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	469,319.11	459,394.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,887,018.79	-11,203,270.21
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	23,776.81	14,025.91
减：二、费用		965,687.26	1,028,504.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	474,235.11	522,988.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	104,331.71	115,057.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	56,390.44	59,998.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	330,730.00	330,460.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,127,077.44	-22,718,230.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,127,077.44	-22,718,230.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

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)	148,771,293.31	-108,584,959.73	40,186,333.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,127,077.44	11,127,077.44
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)	-11,670,272.17	7,496,936.97	-4,173,335.20
其中：1. 基金申购款	44,025,432.14	-29,639,519.75	14,385,912.39
2. 基金赎回款	-55,695,704.31	37,136,456.72	-18,559,247.59
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)	137,101,021.14	-89,960,945.32	47,140,075.82
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)	170,411,754.42	-98,487,892.80	71,923,861.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-22,718,230.72	-22,718,230.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-21,640,461.11	12,621,163.79	-9,019,297.32
其中：1. 基金申购款	23,375,617.12	-15,466,937.73	7,908,679.39

2. 基金赎回款	-45,016,078.23	28,088,101.52	-16,927,976.71
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）	148,771,293.31	-108,584,959.73	40,186,333.58

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：

黄小慧

向辉

张幸骏

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

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(原名为华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金,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[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 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《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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 330,638,859.16 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(2015)第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售,按照每份基金份额 1.00 元计算,本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额,其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华宝中证 1000 基础份额”)、华宝

中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华宝中证 1000A 份额”)和华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华宝中证 1000B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额,将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后,华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+4.0%,华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算,计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后,根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日),本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元,基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配;持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份

额的分配。经过上述份额折算后，华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算(基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日)：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 272 号文审核同意，本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金(不

包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2020 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)和在财务报表附注 7.4.4 所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列

示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在存续期内，本基金（包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额）不进行收益分配。

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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

（3） 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4） 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5） 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	2,706,235.67	2,632,693.09
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,706,235.67	2,632,693.09

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	55,722,928.11	44,169,009.82	-11,553,918.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,800.00	4,294.56
	银行间市场	-	-
	合计	4,800.00	4,294.56
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	55,727,728.11	44,173,304.38	-11,554,423.73

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	66,238,908.09	37,797,465.57	-28,441,442.52
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	66,238,908.09	37,797,465.57	-28,441,442.52

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

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均未持有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	588.02	570.06
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	-	-
应收债券利息	8.65	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.32	0.41
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.66	0.44
合计	597.65	570.91

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

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	13,140.25	66,562.70
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	13,140.25	66,562.70

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	254.65	263.75
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	70,000.00	70,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	120,254.65	120,263.75

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	60,180,650.42	148,771,293.31
本期申购	17,640,864.97	43,609,778.51
本期赎回（以“-”号填列）	-21,698,572.30	-53,641,127.84
- 基金拆分/份额折算前	56,122,943.09	138,739,943.98
基金拆分/份额折算调整	1,929,051.23	-
本期申购	173,918.09	415,653.63
本期赎回（以“-”号填列）	-859,673.42	-2,054,576.47
本期末	57,366,238.99	137,101,021.14

注：1. 本基金的基金份额包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。本期申购含申购的华宝中证 1000 基础份额和配对转入的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额，本期赎回含赎回的华宝中证 1000 基础份额和配对转出的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。

2. 本基金在 2019 年度共发生以下 1 次折算：

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝基金管理有限公司于 2019 年 12 月 17 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金以 2019 年 12 月 13 日为定期折算基准日，进行定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 52,023,682.09 份和 630,903.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.034371889，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 53,811,834.32 份和 771,802.00 份（含华宝中证 1000A 份额经折算后产生的新增华宝中证 1000 基础份额场内份额），份额净值为 0.798 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 1,734,179.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.068743777，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 1,734,179.00 份，份额净值为 1.000 元。

3. 截至 2019 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 4,224,481.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 756,123.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 1,734,179.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 53,141,757.99 份，均为华宝中证 1000 基础份额（2018 年 12 月 31 日：本基金于深交所上市的基金份额为 3,966,308.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 769,380.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 1,598,464.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 56,214,342.42 份，均为华宝中证 1000 基础份额）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	-98,430,827.42	-10,154,132.31	-108,584,959.73
本期利润	-5,759,941.35	16,887,018.79	11,127,077.44
本期基金份额交易产生的变动数	8,013,163.82	-516,226.85	7,496,936.97
其中：基金申购款	-29,560,986.64	-78,533.11	-29,639,519.75
基金赎回款	37,574,150.46	-437,693.74	37,136,456.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-96,177,604.95	6,216,659.63	-89,960,945.32

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	22,857.22	24,671.85
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	259.59	230.99
其他	63.58	78.30
合计	23,180.39	24,981.14

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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	20,850,016.20	22,980,099.28
减：卖出股票成本总额	26,160,555.25	33,964,957.08
买卖股票差价收入	-5,310,539.05	-10,984,857.80

7.4.7.12.2 股票投资收益——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

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.13.4 债券投资收益——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。

7.4.7.15 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

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	469,319.11	459,394.81
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	469,319.11	459,394.81

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	16,887,018.79	-11,203,270.21
股票投资	16,887,524.23	-11,203,270.21
债券投资	-505.44	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	16,887,018.79	-11,203,270.21

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

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

	31 日	12 月 31 日
基金赎回费收入	23,776.81	13,507.48
其他	-	518.43
合计	23,776.81	14,025.91

注：本基金场外的赎回费率按持有期间递减；场内的赎回费率为 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	56,390.44	59,998.42
银行间市场交易费用	-	-
合计	56,390.44	59,998.42

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	40,000.00
信息披露费	50,000.00	30,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	730.00	410.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	-	50.00
合计	330,730.00	330,460.00

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙 （Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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(%)
华宝证券	265,450.91	0.76	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本期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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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(%)
华宝证券	247.24	0.76	247.24	1.88

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 (%)
华宝证券	-	-	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

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	474,235.11	522,988.67
其中：支付销售机构的客户维护费	189,091.51	217,048.81

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 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	104,331.71	115,057.48

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	1000A	1000B	华宝中证 1000 指 数分级	合计
-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
获得销售服务费的各 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			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	1000A	1000B	华宝中证 1000 指 数分级	合计
-	0.00	0.00	0.00	-
合计	-	-	-	-

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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

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

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日
	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分 级

基金合同生效日 (2015年6月4日) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减: 期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分 级
基金合同生效日 (2015年6月4日) 持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00
减: 期间赎回/卖出总 份额	0.00	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	0.00%	0.00%

注: 本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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

中国建设银行股份有限公司	2,706,235.67	22,857.22	2,632,693.09	24,671.85
--------------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

1000A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	-	-	2019 年 12 月 13 日	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

华宝中证 1000 指数分级								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	-	-	2019 年 12 月 13 日	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

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
000029	深深	2016 年	重大资	10.97	-	-	6,200	81,266.58	68,014.00	-

	房 A	09月14日	产重组							
002115	三维通信	2019年12月19日	重大事项	8.89	2020年01月03日	9.08	5,100	51,961.78	45,339.00	-
600966	博汇纸业	2019年12月30日	重大事项	5.31	2020年01月02日	5.84	7,900.00	36,321.83	41,949.00	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

本基金本期末无银行间市场债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末,本基金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

本基金是一只指数型的分级证券投资基金,华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征;华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“以实现与跟踪指数相同”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,公司内部监督和反馈系统包括内部控制

委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，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的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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同责任，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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，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和资产支持证券占基金资产净值的比例较低，因此无重大信用风险。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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、流通受限制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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。此外，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%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变

现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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和存出保证金等。

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	2,706,235.67	-	-	-	2,706,235.67
存出保证金	1,145.30	-	-	-	1,145.30
交易性金融资产	-	-	4,294.56	44,169,009.82	44,173,304.38
应收利息	-	-	-	597.65	597.65
应收申购款	100.00	-	-	11,979.36	12,079.36
应收证券清算款	-	-	-	525,551.83	525,551.83
资产总计	2,707,480.97	-	4,294.56	44,707,138.66	47,418,914.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	97,574.29	97,574.29
应付管理人报酬	-	-	-	39,237.02	39,237.02
应付托管费	-	-	-	8,632.16	8,632.16
应付交易费用	-	-	-	13,140.25	13,140.25
其他负债	-	-	-	120,254.65	120,254.65
负债总计	-	-	-	278,838.37	278,838.37
利率敏感度缺口	2,707,480.97	-	4,294.56	44,428,300.29	47,140,075.82
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	2,632,693.09	-	-	-	2,632,693.09
存出保证金	818.24	-	-	-	818.24
交易性金融资产	-	-	-	37,797,465.57	37,797,465.57
应收利息	-	-	-	570.91	570.91
应收申购款	1,002.81	-	-	25,800.07	26,802.88
应收证券清算款	-	-	-	30,510.65	30,510.65
资产总计	2,634,514.14	-	-	37,854,347.20	40,488,861.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	72,229.05	72,229.05
应付管理人报酬	-	-	-	35,633.00	35,633.00
应付托管费	-	-	-	7,839.26	7,839.26
应付交易费用	-	-	-	66,562.70	66,562.70
其他负债	-	-	-	120,263.75	120,263.75
负债总计	-	-	-	302,527.76	302,527.76
利率敏感度缺口	2,634,514.14	-	-	37,551,819.44	40,186,333.58

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

本报告期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0091%（上年度末：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：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或银行间同业市场交易的股票和债券，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进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等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

金额单位：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	44,169,009.82	93.70	37,797,465.57	94.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	44,169,009.82	93.70	37,797,465.57	94.06

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		
	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）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,306,706.51	2,001,388.72
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,306,706.51	-2,001,388.72

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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) 公允价值

(a) 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银行存款、存出保证金、应收利息、应收申购款、应收证券清算款以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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 44,007,129.78 元，属于第二层次的余额为 166,174.60 元，无属于第三层次的余额（于上年度末，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 37,724,412.57 元，属于第二层次的余额为 73,053.00 元，无划分为第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3) 其他事项

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金基金资产净值已连续超过六十个工作日低于 5000 万元。根据相关规定，基金管理人已拟定解决方案，目前已通过证监会备案，基金管理人将尽快付诸实施，并及时履行信息披露义务。

§ 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	44,169,009.82	93.15
	其中：股票	44,169,009.82	93.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,294.56	0.01
	其中：债券	4,294.56	0.01
	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	2,706,235.67	5.71
8	其他各项资产	539,374.14	1.14
9	合计	47,418,914.19	100.00

注：由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告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	454,930.20	0.97
B	采矿业	788,903.62	1.67
C	制造业	24,769,800.49	52.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	883,542.20	1.87
E	建筑业	955,811.71	2.03
F	批发和零售业	1,360,890.78	2.89
G	交通运输、仓储和邮政业	900,695.86	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,078,734.51	10.77
J	金融业	394,927.70	0.84
K	房地产业	1,380,709.73	2.93
L	租赁和商务服务业	455,640.89	0.97
M	科学研究和技术服务业	560,332.99	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	559,081.64	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,185.00	0.05
Q	卫生和社会工作	124,973.16	0.27
R	文化、体育和娱乐业	498,098.69	1.06
S	综合	209,047.70	0.44
	合计	39,401,306.87	83.58

8.2.2 报告期末积极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	44,383.70	0.09
B	采矿业	53,310.00	0.11
C	制造业	2,751,204.97	5.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,053.00	0.12
E	建筑业	15,256.80	0.03
F	批发和零售业	97,258.00	0.21
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	472,813.10	1
J	金融业	-	-
K	房地产业	242,577.00	0.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	293,463.50	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	98,086.18	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	29,189.00	0.06
Q	卫生和社会工作	520,844.50	1.1
R	文化、体育和娱乐业	92,263.20	0.2
S	综合	-	-
	合计	4,767,702.95	10.11

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 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	15,500.00	249,550.00	0.53
2	300450	先导智能	5,100.00	229,194.00	0.49
3	300271	华宇软件	6,380.00	162,052.00	0.34
4	002185	华天科技	20,171.00	150,677.37	0.32
5	002138	顺络电子	6,300.00	145,530.00	0.31
6	000540	中天金融	40,600.00	135,198.00	0.29
7	002396	星网锐捷	3,800.00	135,128.00	0.29
8	300357	我武生物	3,040.00	134,216.00	0.28
9	300558	贝达药业	2,000.00	131,400.00	0.28
10	300661	圣邦股份	520	131,289.60	0.28
11	300212	易华录	3,736.00	124,931.84	0.27
12	300782	卓胜微	300	123,111.00	0.26
13	300699	光威复材	2,560.00	116,480.00	0.25
14	300676	华大基因	1,600.00	109,920.00	0.23
15	600529	山东药玻	3,940.00	108,901.60	0.23

16	300618	寒锐钴业	1,280.00	105,459.20	0.22
17	002123	梦网集团	5,500.00	105,215.00	0.22
18	300496	中科创达	2,327.00	105,040.78	0.22
19	600797	浙大网新	10,200.00	102,714.00	0.22
20	300369	绿盟科技	5,600.00	101,472.00	0.22
21	300223	北京君正	1,160.00	101,094.00	0.21
22	300226	上海钢联	1,286.00	100,050.80	0.21
23	002124	天邦股份	7,900.00	99,145.00	0.21
24	300379	东方通	2,100.00	97,125.00	0.21
25	300326	凯利泰	7,100.00	96,205.00	0.2
26	000735	罗牛山	9,200.00	93,472.00	0.2
27	600641	万业企业	4,900.00	92,120.00	0.2
28	002156	通富微电	5,570.00	91,626.50	0.19
29	600635	大众公用	18,500.00	90,835.00	0.19
30	002036	联创电子	5,310.00	90,323.10	0.19
31	002035	华帝股份	6,730.00	90,316.60	0.19
32	002675	东诚药业	5,600.00	90,216.00	0.19
33	300073	当升科技	3,300.00	90,090.00	0.19
34	000818	航锦科技	4,500.00	89,910.00	0.19
35	300339	润和软件	6,400.00	88,768.00	0.19
36	300482	万孚生物	1,700.00	88,009.00	0.19
37	002402	和而泰	6,750.00	87,277.50	0.19
38	600252	中恒集团	26,700.00	87,042.00	0.18
39	300457	赢合科技	2,550.00	86,572.50	0.18
40	002557	洽洽食品	2,500.00	84,925.00	0.18
41	300352	北信源	11,575.00	84,381.75	0.18
42	002648	卫星石化	5,100.00	83,385.00	0.18
43	300118	东方日升	6,000.00	83,100.00	0.18
44	601058	赛轮轮胎	18,440.00	82,426.80	0.17
45	002511	中顺洁柔	6,455.00	81,720.30	0.17
46	001914	招商积余	4,000.00	81,160.00	0.17
47	000800	一汽轿车	8,100.00	80,757.00	0.17
48	002063	远光软件	6,700.00	80,735.00	0.17
49	002643	万润股份	5,300.00	80,507.00	0.17
50	300188	美亚柏科	4,700.00	80,370.00	0.17
51	600601	方正科技	21,900.00	80,154.00	0.17
51	601636	旗滨集团	14,600.00	80,154.00	0.17
53	300037	新宙邦	2,200.00	79,948.00	0.17
54	300294	博雅生物	2,550.00	79,636.50	0.17
55	002458	益生股份	2,790.00	79,096.50	0.17
56	600323	瀚蓝环境	4,500.00	78,930.00	0.17
57	000799	酒鬼酒	2,200.00	78,870.00	0.17

58	600864	哈投股份	9,700.00	78,182.00	0.17
59	300451	创业慧康	4,350.00	78,039.00	0.17
60	002100	天康生物	6,100.00	77,958.00	0.17
61	002436	兴森科技	9,500.00	77,330.00	0.16
62	000710	贝瑞基因	2,100.00	76,860.00	0.16
63	300747	锐科激光	650	76,570.00	0.16
64	000739	普洛药业	5,900.00	76,523.00	0.16
65	300630	普利制药	1,350.00	76,464.00	0.16
66	300079	数码科技	12,900.00	76,368.00	0.16
67	002237	恒邦股份	5,400.00	75,816.00	0.16
68	000591	太阳能	20,660.00	75,615.60	0.16
69	300463	迈克生物	2,800.00	75,516.00	0.16
70	002683	宏大爆破	4,000.00	75,400.00	0.16
71	600812	华北制药	7,600.00	74,784.00	0.16
72	300595	欧普康视	1,580.00	74,781.40	0.16
73	002597	金禾实业	3,300.00	74,613.00	0.16
74	002080	中材科技	6,014.00	74,573.60	0.16
75	000516	国际医学	15,300.00	74,205.00	0.16
76	300476	胜宏科技	4,520.00	73,721.20	0.16
77	000917	电广传媒	10,800.00	72,792.00	0.15
78	600720	祁连山	5,800.00	72,790.00	0.15
79	000831	五矿稀土	5,600.00	72,576.00	0.15
80	002023	海特高新	6,000.00	72,300.00	0.15
81	600711	盛屯矿业	13,600.00	71,944.00	0.15
82	300098	高新兴	12,063.00	71,533.59	0.15
83	300078	思创医惠	5,824.00	71,518.72	0.15
84	600320	振华重工	19,680.00	71,438.40	0.15
85	000672	上峰水泥	3,900.00	71,331.00	0.15
86	002332	仙琚制药	7,200.00	71,064.00	0.15
87	600206	有研新材	5,800.00	70,760.00	0.15
88	002151	北斗星通	2,800.00	70,672.00	0.15
89	300474	景嘉微	1,200.00	70,296.00	0.15
90	600490	鹏欣资源	15,100.00	70,215.00	0.15
91	600305	恒顺醋业	4,600.00	70,150.00	0.15
92	300036	超图软件	3,500.00	69,755.00	0.15
93	002025	航天电器	2,600.00	69,082.00	0.15
94	600702	舍得酒业	2,300.00	69,023.00	0.15
95	601375	中原证券	12,800.00	68,608.00	0.15
96	002099	海翔药业	9,600.00	68,352.00	0.14
97	600667	太极实业	8,400.00	68,124.00	0.14
98	300170	汉得信息	7,000.00	67,830.00	0.14
99	300053	欧比特	5,445.00	67,626.90	0.14

100	002292	奥飞娱乐	6,800.00	67,524.00	0.14
101	600559	老白干酒	6,005.00	67,496.20	0.14
102	000667	美好置业	24,600.00	67,158.00	0.14
103	600491	龙元建设	9,100.00	66,521.00	0.14
104	600756	浪潮软件	3,200.00	66,176.00	0.14
105	603222	济民制药	1,200.00	66,000.00	0.14
106	300567	精测电子	1,200.00	65,808.00	0.14
107	300054	鼎龙股份	6,640.00	65,736.00	0.14
108	002042	华孚时尚	8,950.00	65,693.00	0.14
109	002568	百润股份	2,500.00	65,675.00	0.14
110	000034	神州数码	3,300.00	65,505.00	0.14
111	603345	安井食品	1,100.00	65,351.00	0.14
112	002727	一心堂	2,800.00	65,128.00	0.14
113	300456	耐威科技	2,640.00	64,996.80	0.14
114	600868	梅雁吉祥	18,800.00	64,860.00	0.14
115	600986	科达股份	13,040.00	64,678.40	0.14
116	002547	春兴精工	7,800.00	64,116.00	0.14
117	600803	新奥股份	6,000.00	63,840.00	0.14
118	300322	硕贝德	3,100.00	63,426.00	0.13
119	600850	华东电脑	2,500.00	63,400.00	0.13
120	002912	中新赛克	500	63,000.00	0.13
121	002389	航天彩虹	5,600.00	62,160.00	0.13
122	600612	老凤祥	1,300.00	61,893.00	0.13
123	002449	国星光电	4,830.00	61,775.70	0.13
124	600330	天通股份	7,680.00	61,747.20	0.13
125	601519	大智慧	7,800.00	61,542.00	0.13
126	002126	银轮股份	7,600.00	61,484.00	0.13
127	002697	红旗连锁	8,140.00	61,457.00	0.13
128	300068	南都电源	5,700.00	61,446.00	0.13
129	600093	易见股份	4,400.00	61,424.00	0.13
130	000683	远兴能源	27,040.00	61,380.80	0.13
131	600621	华鑫股份	4,000.00	61,240.00	0.13
132	300458	全志科技	1,906.00	60,972.94	0.13
133	603678	火炬电子	2,650.00	60,791.00	0.13
134	002351	漫步者	2,700.00	60,750.00	0.13
135	300724	捷佳伟创	1,600.00	60,624.00	0.13
136	000560	我爱我家	13,980.00	60,253.80	0.13
137	002020	京新药业	5,600.00	60,144.00	0.13
138	002429	兆驰股份	17,200.00	59,856.00	0.13
139	600185	格力地产	12,280.00	59,435.20	0.13
140	002326	永太科技	5,996.00	59,360.40	0.13
141	603368	柳药股份	1,764.00	59,340.96	0.13

142	000933	神火股份	10,800.00	59,184.00	0.13
143	300038	数知科技	6,860.00	59,133.20	0.13
144	600072	中船科技	4,400.00	58,872.00	0.12
145	002261	拓维信息	7,100.00	58,788.00	0.12
146	000035	中国天楹	9,500.00	58,615.00	0.12
147	000951	中国重汽	2,600.00	58,500.00	0.12
148	000968	蓝焰控股	5,700.00	58,482.00	0.12
149	600604	市北高新	6,600.00	58,476.00	0.12
150	002276	万马股份	7,000.00	58,170.00	0.12
151	002481	双塔食品	7,300.00	57,962.00	0.12
152	002413	雷科防务	10,600.00	57,664.00	0.12
152	600771	广誉远	3,400.00	57,664.00	0.12
154	603708	家家悦	2,368.00	57,637.12	0.12
155	002497	雅化集团	7,400.00	57,498.00	0.12
156	600131	国网信通	2,900.00	57,478.00	0.12
157	002262	恩华药业	4,936.00	57,405.68	0.12
158	002467	二六三	10,630.00	57,295.70	0.12
159	000059	华锦股份	9,400.00	57,246.00	0.12
160	600226	瀚叶股份	18,206.00	57,166.84	0.12
161	300130	新国都	3,240.00	57,121.20	0.12
162	002851	麦格米特	2,750.00	56,980.00	0.12
163	002610	爱康科技	35,100.00	56,511.00	0.12
164	300348	长亮科技	2,700.00	56,484.00	0.12
165	603737	三棵树	700	56,455.00	0.12
166	000555	神州信息	3,800.00	56,278.00	0.12
167	300685	艾德生物	840	56,128.80	0.12
168	300725	药石科技	820	56,030.60	0.12
169	600422	昆药集团	5,200.00	55,796.00	0.12
170	600984	建设机械	5,400.00	55,782.00	0.12
171	002216	三全食品	3,900.00	55,770.00	0.12
171	300666	江丰电子	1,300.00	55,770.00	0.12
173	002376	新北洋	4,600.00	55,660.00	0.12
174	002079	苏州固锟	4,700.00	55,648.00	0.12
175	000789	万年青	4,550.00	55,555.50	0.12
176	600483	福能股份	6,000.00	55,200.00	0.12
177	002733	雄韬股份	2,050.00	55,104.00	0.12
178	600546	山煤国际	7,800.00	54,444.00	0.12
179	000650	仁和药业	8,600.00	54,352.00	0.12
180	300284	苏交科	6,652.00	54,346.84	0.12
181	000921	海信家电	4,400.00	54,252.00	0.12
182	002531	天顺风能	8,580.00	54,225.60	0.12
183	300085	银之杰	3,500.00	54,180.00	0.11

184	600596	新安股份	5,500.00	54,120.00	0.11
185	002234	民和股份	1,700.00	54,077.00	0.11
186	000697	炼石航空	5,100.00	54,060.00	0.11
187	300523	辰安科技	1,200.00	53,832.00	0.11
188	300616	尚品宅配	720	53,654.40	0.11
189	002446	盛路通信	5,920.00	53,576.00	0.11
190	600517	置信电气	6,500.00	53,560.00	0.11
191	600363	联创光电	3,500.00	53,515.00	0.11
192	000875	吉电股份	17,000.00	53,380.00	0.11
193	600110	诺德股份	11,300.00	52,884.00	0.11
194	603605	珀莱雅	600	52,830.00	0.11
195	002192	融捷股份	2,100.00	52,794.00	0.11
196	600602	云赛智联	6,400.00	52,736.00	0.11
197	002091	江苏国泰	7,660.00	52,624.20	0.11
198	600993	马应龙	3,000.00	52,470.00	0.11
199	600337	美克家居	11,800.00	52,274.00	0.11
200	300502	新易盛	1,300.00	52,182.00	0.11
201	600668	尖峰集团	3,300.00	52,140.00	0.11
202	600562	国睿科技	3,632.00	52,082.88	0.11
203	300232	洲明科技	5,248.00	52,007.68	0.11
204	300770	新媒股份	400	52,000.00	0.11
205	300203	聚光科技	3,100.00	51,801.00	0.11
206	603118	共进股份	4,600.00	51,704.00	0.11
207	002168	惠程科技	6,300.00	51,660.00	0.11
208	601588	北辰实业	15,700.00	51,496.00	0.11
209	000733	振华科技	3,000.00	51,450.00	0.11
210	000851	高鸿股份	8,900.00	51,442.00	0.11
211	000902	新洋丰	6,500.00	51,350.00	0.11
212	000793	华闻集团	15,200.00	51,224.00	0.11
213	000931	中关村	5,200.00	51,012.00	0.11
214	600456	宝钛股份	2,100.00	51,009.00	0.11
215	000603	盛达资源	3,400.00	50,966.00	0.11
216	600063	皖维高新	13,000.00	50,960.00	0.11
217	300602	飞荣达	1,200.00	50,880.00	0.11
218	300679	电连技术	1,330.00	50,606.50	0.11
219	300377	赢时胜	4,400.00	50,556.00	0.11
220	000546	金圆股份	5,000.00	50,500.00	0.11
220	300292	吴通控股	10,000.00	50,500.00	0.11
222	000810	创维数字	4,200.00	50,358.00	0.11
223	601567	三星医疗	6,800.00	50,320.00	0.11
224	600378	昊华科技	2,600.00	50,206.00	0.11
225	601222	林洋能源	10,308.00	50,096.88	0.11

226	002657	中科金财	2,700.00	50,058.00	0.11
227	002097	山河智能	8,500.00	49,980.00	0.11
228	601918	新集能源	15,400.00	49,896.00	0.11
229	600326	西藏天路	6,800.00	49,844.00	0.11
230	000070	特发信息	4,580.00	49,693.00	0.11
231	002512	达华智能	7,700.00	49,665.00	0.11
232	601011	宝泰隆	11,000.00	49,610.00	0.11
233	002649	博彦科技	5,000.00	49,600.00	0.11
234	000915	山大华特	1,870.00	49,555.00	0.11
235	002488	金固股份	6,950.00	49,553.50	0.11
236	002705	新宝股份	3,000.00	49,470.00	0.1
237	000926	福星股份	7,600.00	49,400.00	0.1
238	600789	鲁抗医药	6,840.00	49,316.40	0.1
239	600503	华丽家族	15,500.00	49,290.00	0.1
240	600831	广电网络	5,300.00	49,078.00	0.1
241	603026	石大胜华	1,400.00	49,028.00	0.1
242	603027	千禾味业	2,300.00	48,898.00	0.1
243	000049	德赛电池	1,200.00	48,888.00	0.1
244	000976	华铁股份	9,500.00	48,830.00	0.1
245	300300	汉鼎宇佑	4,575.00	48,815.25	0.1
246	002626	金达威	2,500.00	48,750.00	0.1
247	600685	中船防务	3,300.00	48,675.00	0.1
248	600761	安徽合力	5,000.00	48,650.00	0.1
249	603043	广州酒家	1,600.00	48,592.00	0.1
250	002430	杭氧股份	3,600.00	48,456.00	0.1
251	601677	明泰铝业	4,200.00	48,426.00	0.1
252	002421	达实智能	13,400.00	48,374.00	0.1
253	600284	浦东建设	7,600.00	48,260.00	0.1
254	300572	安车检测	1,000.00	48,080.00	0.1
255	000016	深康佳 A	11,000.00	48,070.00	0.1
256	002145	中核钛白	10,900.00	47,633.00	0.1
257	000901	航天科技	4,250.00	47,600.00	0.1
258	002798	帝欧家居	1,900.00	47,595.00	0.1
259	600360	华微电子	7,200.00	47,448.00	0.1
260	601163	三角轮胎	3,100.00	47,430.00	0.1
261	600742	一汽富维	3,920.00	47,392.80	0.1
262	002777	久远银海	1,300.00	47,320.00	0.1
263	600269	赣粤高速	11,400.00	47,082.00	0.1
264	002611	东方精工	11,040.00	46,920.00	0.1
265	002647	仁东控股	2,800.00	46,872.00	0.1
266	300256	星星科技	7,750.00	46,810.00	0.1
267	600988	赤峰黄金	9,300.00	46,779.00	0.1

268	300748	金力永磁	1,200.00	46,752.00	0.1
269	002022	科华生物	4,000.00	46,720.00	0.1
269	002565	顺灏股份	7,300.00	46,720.00	0.1
271	002117	东港股份	3,750.00	46,687.50	0.1
272	300735	光弘科技	1,790.00	46,683.20	0.1
273	000688	国城矿业	3,400.00	46,614.00	0.1
274	002251	步步高	5,100.00	46,410.00	0.1
275	002618	丹邦科技	3,750.00	46,237.50	0.1
276	601666	平煤股份	11,500.00	46,230.00	0.1
277	300303	聚飞光电	8,240.00	46,226.40	0.1
278	300353	东土科技	3,600.00	46,152.00	0.1
279	603323	苏农银行	8,710.00	46,075.90	0.1
280	300055	万邦达	6,900.00	46,023.00	0.1
281	300185	通裕重工	25,700.00	46,003.00	0.1
282	603399	吉翔股份	3,400.00	45,900.00	0.1
283	000708	中信特钢	2,000.00	45,860.00	0.1
284	600851	海欣股份	5,700.00	45,828.00	0.1
285	601929	吉视传媒	21,500.00	45,795.00	0.1
286	600587	新华医疗	3,200.00	45,696.00	0.1
287	300236	上海新阳	1,650.00	45,655.50	0.1
288	300233	金城医药	2,300.00	45,655.00	0.1
289	600846	同济科技	4,900.00	45,619.00	0.1
290	002047	宝鹰股份	7,900.00	45,583.00	0.1
291	300438	鹏辉能源	1,700.00	45,560.00	0.1
292	603638	艾迪精密	1,495.00	45,537.70	0.1
293	600764	中国海防	1,600.00	45,536.00	0.1
294	002115	三维通信	5,100.00	45,339.00	0.1
295	600366	宁波韵升	6,800.00	45,288.00	0.1
296	002489	浙江永强	10,800.00	45,252.00	0.1
297	300145	中金环境	13,040.00	45,248.80	0.1
298	002400	省广集团	13,700.00	45,210.00	0.1
299	002171	楚江新材	6,100.00	45,201.00	0.1
300	000676	智度股份	5,000.00	45,200.00	0.1
301	002428	云南锗业	5,300.00	45,103.00	0.1
302	002318	久立特材	4,800.00	45,024.00	0.1
303	603596	伯特利	2,000.00	45,000.00	0.1
304	002859	洁美科技	1,300.00	44,993.00	0.1
305	600116	三峡水利	5,900.00	44,781.00	0.09
306	000910	大亚圣象	3,200.00	44,768.00	0.09
307	600459	贵研铂业	2,950.00	44,545.00	0.09
308	600210	紫江企业	11,800.00	44,486.00	0.09
309	000900	现代投资	10,200.00	44,472.00	0.09

310	600129	太极集团	3,900.00	44,343.00	0.09
311	002639	雪人股份	5,200.00	44,304.00	0.09
312	600108	亚盛集团	15,200.00	44,232.00	0.09
313	600936	广西广电	11,500.00	44,160.00	0.09
314	000836	富通鑫茂	11,900.00	44,149.00	0.09
315	000592	平潭发展	15,200.00	44,080.00	0.09
316	002139	拓邦股份	7,925.00	44,063.00	0.09
317	300596	利安隆	1,200.00	44,052.00	0.09
318	002254	泰和新材	4,200.00	43,890.00	0.09
319	300327	中颖电子	1,700.00	43,792.00	0.09
320	002301	齐心集团	3,600.00	43,776.00	0.09
321	603236	移远通信	300	43,770.00	0.09
322	600057	厦门象屿	10,526.00	43,682.90	0.09
323	000036	华联控股	10,110.00	43,574.10	0.09
324	002313	日海智能	2,200.00	43,560.00	0.09
324	600285	羚锐制药	4,400.00	43,560.00	0.09
326	600611	大众交通	10,700.00	43,442.00	0.09
327	300287	飞利信	11,300.00	43,392.00	0.09
328	600740	山西焦化	5,800.00	43,268.00	0.09
329	601369	陕鼓动力	6,500.00	43,225.00	0.09
330	603456	九洲药业	3,100.00	43,214.00	0.09
331	002073	软控股份	9,200.00	43,056.00	0.09
332	002530	金财互联	3,720.00	43,040.40	0.09
333	600123	兰花科创	6,700.00	43,014.00	0.09
334	000918	嘉凯城	7,200.00	42,984.00	0.09
335	000582	北部湾港	4,800.00	42,960.00	0.09
336	603606	东方电缆	3,900.00	42,822.00	0.09
337	000088	盐田港	7,600.00	42,788.00	0.09
338	300664	鹏鹞环保	3,300.00	42,768.00	0.09
339	002537	海联金汇	6,080.00	42,681.60	0.09
340	002567	唐人神	4,750.00	42,560.00	0.09
341	600783	鲁信创投	2,700.00	42,498.00	0.09
342	300184	力源信息	5,840.00	42,340.00	0.09
343	300137	先河环保	5,500.00	42,240.00	0.09
344	002717	岭南股份	8,980.00	42,206.00	0.09
345	000429	粤高速 A	5,100.00	42,126.00	0.09
346	002130	沃尔核材	8,500.00	41,990.00	0.09
347	600624	复旦复华	4,330.00	41,957.70	0.09
348	600966	博汇纸业	7,900.00	41,949.00	0.09
349	002383	合众思壮	4,500.00	41,940.00	0.09
350	002104	恒宝股份	5,476.00	41,891.40	0.09
351	000958	东方能源	7,500.00	41,850.00	0.09

351	600146	商赢环球	3,100.00	41,850.00	0.09
353	002409	雅克科技	1,800.00	41,760.00	0.09
354	300429	强力新材	2,503.00	41,725.01	0.09
355	000720	新能泰山	7,600.00	41,420.00	0.09
356	600496	精工钢构	14,300.00	41,327.00	0.09
357	600169	太原重工	17,700.00	41,241.00	0.09
358	002222	福晶科技	3,350.00	41,104.50	0.09
359	300401	花园生物	3,300.00	41,085.00	0.09
360	002698	博实股份	3,900.00	41,028.00	0.09
361	600502	安徽建工	10,056.00	40,827.36	0.09
362	603718	海利生物	3,185.00	40,768.00	0.09
363	002182	云海金属	4,400.00	40,700.00	0.09
364	300406	九强生物	2,500.00	40,650.00	0.09
365	600775	南京熊猫	4,000.00	40,640.00	0.09
366	002822	中装建设	4,100.00	40,549.00	0.09
367	603599	广信股份	2,700.00	40,473.00	0.09
368	300177	中海达	4,550.00	40,404.00	0.09
369	600261	阳光照明	8,500.00	40,375.00	0.09
370	600531	豫光金铅	8,600.00	40,334.00	0.09
371	002343	慈文传媒	3,330.00	40,326.30	0.09
372	002550	千红制药	8,800.00	40,304.00	0.09
373	000726	鲁泰 A	4,400.00	40,260.00	0.09
374	000795	英洛华	6,600.00	40,194.00	0.09
375	300298	三诺生物	2,680.00	40,173.20	0.09
376	300238	冠昊生物	2,100.00	40,131.00	0.09
377	000040	东旭蓝天	9,600.00	40,128.00	0.09
378	600990	四创电子	900	40,122.00	0.09
379	002617	露笑科技	7,399.00	40,102.58	0.09
380	600059	古越龙山	4,700.00	39,997.00	0.08
381	000969	安泰科技	6,000.00	39,960.00	0.08
382	002303	美盈森	7,500.00	39,825.00	0.08
383	000682	东方电子	7,900.00	39,816.00	0.08
384	300737	科顺股份	3,500.00	39,620.00	0.08
385	001696	宗申动力	6,800.00	39,576.00	0.08
386	000829	天音控股	6,300.00	39,501.00	0.08
387	300222	科大智能	4,220.00	39,372.60	0.08
388	300047	天源迪科	4,945.00	39,362.20	0.08
389	000507	珠海港	6,400.00	39,296.00	0.08
390	300568	星源材质	1,300.00	39,273.00	0.08
391	300007	汉威科技	2,400.00	39,264.00	0.08
392	601010	文峰股份	12,800.00	39,168.00	0.08
393	300045	华力创通	4,200.00	39,144.00	0.08

394	002498	汉缆股份	13,000.00	39,130.00	0.08
395	000936	华西股份	5,000.00	39,050.00	0.08
396	300031	宝通科技	2,600.00	39,000.00	0.08
397	002043	兔宝宝	5,300.00	38,955.00	0.08
397	002832	比音勒芬	1,500.00	38,955.00	0.08
399	600750	江中药业	3,100.00	38,843.00	0.08
400	300194	福安药业	7,000.00	38,780.00	0.08
401	300527	中国应急	3,543.00	38,760.42	0.08
402	300083	劲胜智能	9,700.00	38,703.00	0.08
403	300363	博腾股份	2,700.00	38,637.00	0.08
404	600736	苏州高新	6,600.00	38,478.00	0.08
405	300043	星辉娱乐	7,500.00	38,475.00	0.08
405	300131	英唐智控	7,500.00	38,475.00	0.08
407	300149	量子生物	2,900.00	38,454.00	0.08
408	600175	美都能源	21,100.00	38,402.00	0.08
409	603012	创力集团	4,300.00	38,356.00	0.08
410	600020	中原高速	8,700.00	38,280.00	0.08
411	300394	天孚通信	1,000.00	38,260.00	0.08
412	300266	兴源环境	10,900.00	38,259.00	0.08
413	300366	创意信息	3,700.00	38,258.00	0.08
414	600708	光明地产	10,867.00	38,251.84	0.08
415	600681	百川能源	5,620.00	38,216.00	0.08
416	002364	中恒电气	3,300.00	38,181.00	0.08
417	600162	香江控股	16,650.00	38,128.50	0.08
418	300349	金卡智能	2,500.00	38,125.00	0.08
419	000802	北京文化	4,100.00	38,089.00	0.08
420	603018	中设集团	3,700.00	38,073.00	0.08
421	603588	高能环境	4,000.00	38,000.00	0.08
422	603881	数据港	1,000.00	37,950.00	0.08
423	603128	华贸物流	6,000.00	37,860.00	0.08
424	300355	蒙草生态	11,100.00	37,851.00	0.08
425	300020	银江股份	4,500.00	37,800.00	0.08
426	601069	西部黄金	2,500.00	37,750.00	0.08
427	002320	海峡股份	2,945.00	37,696.00	0.08
428	600200	江苏吴中	7,000.00	37,660.00	0.08
429	600105	永鼎股份	8,340.00	37,530.00	0.08
430	002341	新纶科技	6,600.00	37,488.00	0.08
431	300495	美尚生态	3,383.00	37,483.64	0.08
432	002367	康力电梯	4,700.00	37,365.00	0.08
433	601890	亚星锚链	6,500.00	37,180.00	0.08
434	601137	博威合金	3,300.00	37,158.00	0.08
435	300741	华宝股份	1,200.00	37,056.00	0.08

436	002545	东方铁塔	4,900.00	36,995.00	0.08
437	600103	青山纸业	17,870.00	36,990.90	0.08
438	002484	江海股份	4,716.00	36,973.44	0.08
439	002108	沧州明珠	9,442.00	36,918.22	0.08
440	002474	榕基软件	4,300.00	36,765.00	0.08
441	603660	苏州科达	3,340.00	36,740.00	0.08
442	300123	亚光科技	4,840.00	36,735.60	0.08
443	002515	金字火腿	6,720.00	36,691.20	0.08
444	603113	金能科技	3,400.00	36,686.00	0.08
445	000882	华联股份	16,300.00	36,675.00	0.08
446	300487	蓝晓科技	1,000.00	36,500.00	0.08
447	603383	顶点软件	500	36,485.00	0.08
448	000796	凯撒旅业	4,000.00	36,440.00	0.08
449	002850	科达利	800	36,400.00	0.08
450	300034	钢研高纳	2,279.00	36,395.63	0.08
451	600331	宏达股份	13,800.00	36,294.00	0.08
452	000935	四川双马	2,200.00	36,278.00	0.08
453	002663	普邦股份	12,400.00	36,208.00	0.08
454	603393	新天然气	1,300.00	36,127.00	0.08
455	300310	宜通世纪	7,088.00	36,077.92	0.08
456	600577	精达股份	13,200.00	36,036.00	0.08
457	002747	埃斯顿	3,200.00	36,032.00	0.08
458	603068	博通集成	400	36,028.00	0.08
459	000601	韶能股份	6,500.00	36,010.00	0.08
460	300477	合纵科技	4,860.00	35,964.00	0.08
461	600114	东睦股份	4,180.00	35,864.40	0.08
462	600308	华泰股份	7,800.00	35,802.00	0.08
463	600420	现代制药	4,000.00	35,760.00	0.08
464	002596	海南瑞泽	5,500.00	35,750.00	0.08
465	002067	景兴纸业	10,700.00	35,738.00	0.08
466	300323	华灿光电	5,100.00	35,700.00	0.08
467	603686	龙马环卫	3,260.00	35,599.20	0.08
468	603008	喜临门	2,300.00	35,581.00	0.08
469	300044	赛为智能	5,480.00	35,565.20	0.08
470	002668	奥马电器	6,294.00	35,561.10	0.08
471	002298	中电兴发	4,700.00	35,532.00	0.08
472	300101	振芯科技	3,900.00	35,529.00	0.08
473	000996	中国中期	3,350.00	35,510.00	0.08
474	600477	杭萧钢构	12,570.00	35,447.40	0.08
475	002258	利尔化学	2,500.00	35,325.00	0.07
476	300367	东方网力	8,152.00	35,298.16	0.07
477	002215	诺普信	5,300.00	35,298.00	0.07

478	000751	锌业股份	10,900.00	35,207.00	0.07
479	600495	晋西车轴	8,380.00	35,196.00	0.07
480	300311	任子行	3,631.00	35,184.39	0.07
481	600512	腾达建设	12,500.00	35,125.00	0.07
482	300702	天宇股份	700	35,084.00	0.07
483	002605	姚记科技	1,800.00	35,010.00	0.07
484	000666	经纬纺机	3,100.00	34,875.00	0.07
485	300510	金冠股份	4,979.00	34,853.00	0.07
486	000973	佛塑科技	7,500.00	34,800.00	0.07
487	600343	航天动力	3,800.00	34,770.00	0.07
488	002274	华昌化工	5,400.00	34,722.00	0.07
489	600552	凯盛科技	5,900.00	34,692.00	0.07
490	000903	云内动力	13,600.00	34,680.00	0.07
490	603127	昭衍新药	600	34,680.00	0.07
492	600067	冠城大通	8,700.00	34,626.00	0.07
493	002695	煌上煌	2,100.00	34,440.00	0.07
494	002746	仙坛股份	2,210.00	34,409.70	0.07
495	600790	轻纺城	10,100.00	34,340.00	0.07
496	600217	中再资环	6,700.00	34,304.00	0.07
497	002167	东方锆业	4,900.00	34,300.00	0.07
498	300091	金通灵	8,320.00	34,278.40	0.07
499	002031	巨轮智能	17,300.00	34,254.00	0.07
500	002235	安妮股份	3,975.00	34,224.75	0.07
501	300623	捷捷微电	1,300.00	34,216.00	0.07
502	000520	长航凤凰	8,100.00	34,182.00	0.07
502	601949	中国出版	5,400.00	34,182.00	0.07
504	300075	数字政通	3,000.00	34,170.00	0.07
505	600978	宜华生活	11,500.00	34,155.00	0.07
506	600971	恒源煤电	5,700.00	34,086.00	0.07
507	300198	纳川股份	7,880.00	34,041.60	0.07
508	600622	光大嘉宝	8,720.00	34,008.00	0.07
509	002226	江南化工	6,200.00	33,976.00	0.07
510	002737	葵花药业	2,300.00	33,948.00	0.07
511	002135	东南网架	6,200.00	33,790.00	0.07
512	000828	东莞控股	4,100.00	33,784.00	0.07
513	600997	开滦股份	6,200.00	33,728.00	0.07
514	600197	伊力特	2,100.00	33,663.00	0.07
515	002510	天汽模	7,200.00	33,624.00	0.07
516	300328	宜安科技	2,280.00	33,607.20	0.07
517	601700	风范股份	5,200.00	33,592.00	0.07
518	300607	拓斯达	700	33,460.00	0.07
519	002095	生意宝	1,500.00	33,420.00	0.07

520	002792	通宇通讯	1,250.00	33,400.00	0.07
521	601886	江河集团	4,600.00	33,396.00	0.07
522	600571	信雅达	3,500.00	33,355.00	0.07
523	600300	维维股份	11,300.00	33,335.00	0.07
524	600400	红豆股份	9,920.00	33,331.20	0.07
525	000030	富奥股份	7,000.00	33,320.00	0.07
526	603108	润达医疗	3,340.00	33,199.60	0.07
527	300386	飞天诚信	2,100.00	33,159.00	0.07
528	002522	浙江众成	5,400.00	33,156.00	0.07
529	600055	万东医疗	3,200.00	33,024.00	0.07
530	603308	应流股份	2,200.00	33,022.00	0.07
531	300096	易联众	3,400.00	33,014.00	0.07
532	000801	四川九洲	6,100.00	32,940.00	0.07
533	300571	平治信息	600	32,928.00	0.07
534	300102	乾照光电	6,900.00	32,775.00	0.07
535	600981	汇鸿集团	8,800.00	32,736.00	0.07
536	600987	航民股份	5,170.00	32,726.10	0.07
537	002447	晨鑫科技	9,650.00	32,713.50	0.07
538	002664	长鹰信质	2,000.00	32,680.00	0.07
538	300373	扬杰科技	1,900.00	32,680.00	0.07
540	002677	浙江美大	2,440.00	32,598.40	0.07
541	000597	东北制药	4,364.00	32,555.44	0.07
542	300128	锦富技术	8,088.00	32,513.76	0.07
543	000155	川能动力	7,500.00	32,475.00	0.07
544	300114	中航电测	2,850.00	32,433.00	0.07
545	300559	佳发教育	1,100.00	32,230.00	0.07
546	300183	东软载波	2,200.00	32,208.00	0.07
546	600658	电子城	6,100.00	32,208.00	0.07
548	600548	深高速	2,800.00	32,200.00	0.07
549	002462	嘉事堂	2,000.00	32,080.00	0.07
550	600239	云南城投	11,100.00	32,079.00	0.07
551	603609	禾丰牧业	2,700.00	31,941.00	0.07
552	601330	绿色动力	3,000.00	31,890.00	0.07
553	002206	海利得	8,500.00	31,875.00	0.07
554	002041	登海种业	3,300.00	31,779.00	0.07
555	600391	航发科技	2,300.00	31,763.00	0.07
556	300441	鲍斯股份	3,260.00	31,752.40	0.07
557	002061	浙江交科	5,400.00	31,698.00	0.07
558	002585	双星新材	6,890.00	31,625.10	0.07
559	600133	东湖高新	5,900.00	31,624.00	0.07
560	600076	康欣新材	7,200.00	31,608.00	0.07
561	603039	泛微网络	540	31,590.00	0.07

562	300726	宏达电子	1,200.00	31,584.00	0.07
563	002267	陕天然气	4,400.00	31,548.00	0.07
564	600894	广日股份	4,200.00	31,542.00	0.07
565	002564	天沃科技	6,900.00	31,533.00	0.07
566	600636	三爱富	3,100.00	31,496.00	0.07
567	300773	拉卡拉	400	31,388.00	0.07
568	002309	中利集团	5,100.00	31,365.00	0.07
569	600449	宁夏建材	2,800.00	31,248.00	0.07
570	603989	艾华集团	1,430.00	31,202.60	0.07
571	603583	捷昌驱动	700	31,171.00	0.07
572	603111	康尼机电	5,900.00	31,152.00	0.07
573	002277	友阿股份	9,400.00	31,114.00	0.07
574	300365	恒华科技	2,400.00	31,056.00	0.07
575	002240	威华股份	3,900.00	31,005.00	0.07
576	300229	拓尔思	2,400.00	30,960.00	0.07
577	300759	康龙化成	600	30,924.00	0.07
578	600351	亚宝药业	5,300.00	30,899.00	0.07
579	002425	凯撒文化	5,580.00	30,857.40	0.07
580	002166	莱茵生物	3,800.00	30,780.00	0.07
581	300006	莱美药业	5,438.00	30,724.70	0.07
582	000957	中通客车	4,600.00	30,682.00	0.07
583	002307	北新路桥	5,200.00	30,680.00	0.07
584	300788	中信出版	600	30,600.00	0.06
585	300409	道氏技术	2,260.00	30,577.80	0.06
586	600963	岳阳林纸	6,900.00	30,567.00	0.06
587	300039	上海凯宝	6,100.00	30,561.00	0.06
588	603920	世运电路	1,600.00	30,544.00	0.06
589	000927	一汽夏利	5,900.00	30,503.00	0.06
590	000811	冰轮环境	4,350.00	30,493.50	0.06
591	000620	新华联	7,500.00	30,375.00	0.06
592	002768	国恩股份	1,300.00	30,277.00	0.06
593	603613	国联股份	400	30,268.00	0.06
594	300398	飞凯材料	2,020.00	30,199.00	0.06
595	000687	华讯方舟	4,500.00	30,195.00	0.06
596	002224	三力士	4,900.00	30,135.00	0.06
597	300263	隆华科技	5,500.00	30,085.00	0.06
598	002055	得润电子	2,800.00	30,072.00	0.06
599	300224	正海磁材	3,150.00	30,051.00	0.06
600	300215	电科院	4,500.00	29,835.00	0.06
601	300497	富祥股份	1,580.00	29,814.60	0.06
602	603367	辰欣药业	1,800.00	29,790.00	0.06
603	300776	帝尔激光	200	29,746.00	0.06

604	601908	京运通	9,900.00	29,700.00	0.06
605	002293	罗莱生活	3,270.00	29,691.60	0.06
606	600096	云天化	5,600.00	29,680.00	0.06
607	600677	*ST 航通	3,400.00	29,648.00	0.06
608	002614	奥佳华	2,800.00	29,624.00	0.06
609	603508	思维列控	500	29,590.00	0.06
610	000662	天夏智慧	5,500.00	29,535.00	0.06
611	300158	振东制药	6,100.00	29,524.00	0.06
612	603636	南威软件	2,600.00	29,458.00	0.06
613	600590	泰豪科技	5,060.00	29,449.20	0.06
614	002918	蒙娜丽莎	1,470.00	29,429.40	0.06
615	000950	重药控股	5,100.00	29,376.00	0.06
616	600626	申达股份	4,900.00	29,302.00	0.06
617	600090	同济堂	7,000.00	29,260.00	0.06
618	600075	新疆天业	5,780.00	29,246.80	0.06
619	300016	北陆药业	3,250.00	29,217.50	0.06
620	300110	华仁药业	6,920.00	29,202.40	0.06
621	000928	中钢国际	6,020.00	29,197.00	0.06
622	000552	靖远煤电	11,300.00	29,154.00	0.06
623	002308	威创股份	6,300.00	29,106.00	0.06
624	002755	奥赛康	1,800.00	29,088.00	0.06
625	002355	兴民智通	4,300.00	29,068.00	0.06
626	600975	新五丰	3,600.00	28,944.00	0.06
627	600106	重庆路桥	9,306.00	28,941.66	0.06
628	600389	江山股份	1,400.00	28,938.00	0.06
629	002619	艾格拉斯	9,180.00	28,917.00	0.06
630	600710	苏美达	5,200.00	28,860.00	0.06
631	300785	值得买	200	28,804.00	0.06
632	002796	世嘉科技	800	28,800.00	0.06
633	600211	西藏药业	900	28,791.00	0.06
634	601366	利群股份	5,100.00	28,713.00	0.06
635	002283	天润曲轴	7,800.00	28,704.00	0.06
636	600172	黄河旋风	9,860.00	28,692.60	0.06
637	300633	开立医疗	1,200.00	28,680.00	0.06
638	600825	新华传媒	5,000.00	28,650.00	0.06
639	000913	钱江摩托	2,600.00	28,626.00	0.06
640	600662	强生控股	6,300.00	28,602.00	0.06
641	600569	安阳钢铁	11,200.00	28,560.00	0.06
642	002256	兆新股份	11,000.00	28,490.00	0.06
643	002539	云图控股	5,800.00	28,478.00	0.06
644	002327	富安娜	4,100.00	28,454.00	0.06
645	600773	西藏城投	4,900.00	28,420.00	0.06

646	601116	三江购物	2,200.00	28,402.00	0.06
647	600184	光电股份	2,500.00	28,350.00	0.06
648	300751	迈为股份	200	28,290.00	0.06
649	300066	三川智慧	6,100.00	28,243.00	0.06
650	603429	集友股份	800	28,240.00	0.06
651	600458	时代新材	4,000.00	28,200.00	0.06
652	002228	合兴包装	7,000.00	28,140.00	0.06
653	300191	潜能恒信	1,300.00	28,119.00	0.06
654	002197	证通电子	3,500.00	28,000.00	0.06
655	002721	金一文化	4,900.00	27,930.00	0.06
656	601952	苏垦农发	3,990.00	27,890.10	0.06
657	002478	常宝股份	4,700.00	27,824.00	0.06
658	603096	新经典	500	27,650.00	0.06
659	600255	梦舟股份	17,700.00	27,612.00	0.06
660	000550	江铃汽车	2,000.00	27,600.00	0.06
661	000989	九芝堂	3,305.00	27,596.75	0.06
662	300299	富春股份	5,640.00	27,579.60	0.06
663	002443	金洲管道	4,100.00	27,552.00	0.06
664	300065	海兰信	2,250.00	27,427.50	0.06
665	002239	奥特佳	15,400.00	27,412.00	0.06
666	002928	华夏航空	2,250.00	27,405.00	0.06
667	002245	澳洋顺昌	6,700.00	27,403.00	0.06
668	300205	天喻信息	2,500.00	27,400.00	0.06
669	300388	国祯环保	2,600.00	27,378.00	0.06
670	300506	名家汇	3,190.00	27,338.30	0.06
671	002322	理工环科	2,300.00	27,255.00	0.06
672	000525	红太阳	2,800.00	27,216.00	0.06
673	603305	旭升股份	800	27,160.00	0.06
674	600800	天津磁卡	4,900.00	27,146.00	0.06
675	002685	华东重机	4,000.00	27,120.00	0.06
676	603803	瑞斯康达	2,100.00	27,090.00	0.06
677	600855	航天长峰	2,200.00	27,038.00	0.06
678	002344	海宁皮城	6,200.00	27,032.00	0.06
679	002243	通产丽星	1,800.00	27,000.00	0.06
680	000584	哈工智能	4,300.00	26,961.00	0.06
681	603363	傲农生物	1,700.00	26,928.00	0.06
682	600481	双良节能	8,100.00	26,892.00	0.06
683	600523	贵航股份	1,960.00	26,852.00	0.06
684	603313	梦百合	1,270.00	26,809.70	0.06
685	600897	厦门空港	1,200.00	26,808.00	0.06
686	300176	派生科技	2,990.00	26,790.40	0.06
687	002726	龙大肉食	3,824.00	26,768.00	0.06

688	002638	勤上股份	7,250.00	26,752.50	0.06
689	002542	中化岩土	7,150.00	26,741.00	0.06
690	000797	中国武夷	7,641.00	26,667.09	0.06
691	603337	杰克股份	1,272.00	26,661.12	0.06
692	601126	四方股份	4,800.00	26,592.00	0.06
693	002219	恒康医疗	11,100.00	26,529.00	0.06
694	600810	神马股份	3,360.00	26,510.40	0.06
695	300423	鲁亿通	2,000.00	26,480.00	0.06
696	600676	交运股份	6,100.00	26,352.00	0.06
697	600581	八一钢铁	7,400.00	26,344.00	0.06
698	601515	东风股份	3,900.00	26,325.00	0.06
699	300143	盈康生命	2,800.00	26,320.00	0.06
700	600508	上海能源	2,800.00	26,292.00	0.06
701	300081	恒信东方	2,600.00	26,286.00	0.06
702	000925	众合科技	3,900.00	26,130.00	0.06
703	300378	鼎捷软件	1,750.00	26,110.00	0.06
704	300219	鸿利智汇	3,850.00	26,103.00	0.06
705	601107	四川成渝	6,200.00	26,102.00	0.06
706	600322	天房发展	8,700.00	26,100.00	0.06
707	300252	金信诺	2,840.00	25,986.00	0.06
708	300336	新文化	6,350.00	25,971.50	0.06
709	300684	中石科技	1,000.00	25,950.00	0.06
710	002947	恒铭达	400	25,904.00	0.05
711	000055	方大集团	5,350.00	25,840.50	0.05
712	300755	华致酒行	1,140.00	25,832.40	0.05
713	600136	当代明诚	2,100.00	25,830.00	0.05
714	300783	三只松鼠	400	25,748.00	0.05
715	002029	七匹狼	4,400.00	25,740.00	0.05
715	600995	文山电力	3,300.00	25,740.00	0.05
717	603267	鸿远电子	500	25,655.00	0.05
718	000822	山东海化	5,200.00	25,532.00	0.05
719	300208	青岛中程	3,550.00	25,489.00	0.05
720	300368	汇金股份	3,100.00	25,482.00	0.05
721	002279	久其软件	4,180.00	25,372.60	0.05
722	000665	湖北广电	4,740.00	25,359.00	0.05
723	600227	圣济堂	10,100.00	25,351.00	0.05
724	603979	金诚信	2,834.00	25,307.62	0.05
725	000065	北方国际	2,925.00	25,301.25	0.05
726	600798	宁波海运	7,100.00	25,276.00	0.05
727	601858	中国科传	2,300.00	25,208.00	0.05
728	002621	美吉姆	2,300.00	25,185.00	0.05
729	002582	好想你	3,000.00	25,170.00	0.05

730	002060	粤水电	8,300.00	25,149.00	0.05
731	300638	广和通	400	25,080.00	0.05
732	300255	常山药业	4,600.00	25,024.00	0.05
733	300302	同有科技	2,040.00	24,969.60	0.05
734	002930	宏川智慧	1,660.00	24,933.20	0.05
735	002929	润建股份	900	24,930.00	0.05
736	300021	大禹节水	4,700.00	24,910.00	0.05
737	002636	金安国纪	2,900.00	24,853.00	0.05
738	600382	广东明珠	3,550.00	24,814.50	0.05
739	300504	天邑股份	1,100.00	24,794.00	0.05
740	600603	广汇物流	5,000.00	24,750.00	0.05
741	603458	勘设股份	1,295.00	24,721.55	0.05
742	002650	加加食品	6,900.00	24,702.00	0.05
743	300276	三丰智能	3,100.00	24,645.00	0.05
744	002393	力生制药	900	24,597.00	0.05
745	600691	阳煤化工	11,700.00	24,570.00	0.05
746	002314	南山控股	8,000.00	24,560.00	0.05
747	603169	兰石重装	4,200.00	24,528.00	0.05
748	600318	新力金融	3,500.00	24,500.00	0.05
749	300107	建新股份	3,300.00	24,486.00	0.05
750	000150	宜华健康	5,104.00	24,448.16	0.05
751	002204	大连重工	7,600.00	24,396.00	0.05
752	600230	沧州大化	2,360.00	24,378.80	0.05
753	000615	京汉股份	5,500.00	24,365.00	0.05
754	002433	太安堂	5,300.00	24,327.00	0.05
755	603063	禾望电气	2,600.00	24,284.00	0.05
756	002518	科士达	2,275.00	24,274.25	0.05
757	300209	天泽信息	1,700.00	24,259.00	0.05
758	300359	全通教育	4,250.00	24,182.50	0.05
759	600229	城市传媒	3,400.00	24,140.00	0.05
760	002137	麦达数字	3,300.00	24,024.00	0.05
761	002581	未名医药	3,300.00	23,892.00	0.05
762	002556	辉隆股份	4,200.00	23,856.00	0.05
763	603869	新智认知	2,000.00	23,840.00	0.05
764	002955	鸿合科技	400	23,804.00	0.05
765	600715	文投控股	6,700.00	23,785.00	0.05
766	000532	华金资本	2,000.00	23,780.00	0.05
767	300761	立华股份	400	23,760.00	0.05
768	600933	爱柯迪	1,700.00	23,698.00	0.05
769	002034	旺能环境	1,600.00	23,696.00	0.05
770	002913	奥士康	400	23,676.00	0.05
771	000639	西王食品	5,224.00	23,664.72	0.05

772	002901	大博医疗	400	23,636.00	0.05
773	600929	湖南盐业	3,600.00	23,616.00	0.05
774	300213	佳讯飞鸿	3,600.00	23,544.00	0.05
775	002121	科陆电子	5,500.00	23,540.00	0.05
776	000544	中原环保	3,750.00	23,475.00	0.05
777	601101	昊华能源	4,800.00	23,472.00	0.05
778	000038	深大通	1,980.00	23,463.00	0.05
779	603359	东珠生态	1,560.00	23,384.40	0.05
780	000889	中嘉博创	2,500.00	23,375.00	0.05
781	002756	永兴材料	1,300.00	23,335.00	0.05
782	603727	博迈科	1,200.00	23,304.00	0.05
783	300148	天舟文化	5,900.00	23,246.00	0.05
784	603298	杭叉集团	1,800.00	23,184.00	0.05
785	300467	迅游科技	1,200.00	23,160.00	0.05
786	002712	思美传媒	2,760.00	23,156.40	0.05
787	000657	中钨高新	3,380.00	23,153.00	0.05
788	603357	设计总院	2,200.00	23,144.00	0.05
789	000892	欢瑞世纪	4,600.00	23,046.00	0.05
790	600480	凌云股份	3,000.00	23,040.00	0.05
791	000815	美利云	3,400.00	23,018.00	0.05
792	601606	长城军工	2,100.00	22,974.00	0.05
793	603826	坤彩科技	1,400.00	22,946.00	0.05
794	600054	黄山旅游	2,500.00	22,925.00	0.05
795	600035	楚天高速	6,700.00	22,847.00	0.05
796	002840	华统股份	1,400.00	22,820.00	0.05
797	300343	联创股份	7,917.00	22,721.79	0.05
798	002751	易尚展示	900	22,644.00	0.05
799	600758	红阳能源	5,200.00	22,568.00	0.05
800	002464	众应互联	3,534.00	22,546.92	0.05
801	600231	凌钢股份	8,160.00	22,521.60	0.05
802	002148	北纬科技	4,360.00	22,497.60	0.05
803	600550	保变电气	7,300.00	22,484.00	0.05
804	002630	华西能源	9,400.00	22,466.00	0.05
805	300248	新开普	2,723.00	22,355.83	0.05
806	002284	亚太股份	4,400.00	22,352.00	0.05
807	002229	鸿博股份	3,350.00	22,311.00	0.05
808	000711	京蓝科技	4,100.00	22,304.00	0.05
809	600278	东方创业	2,100.00	22,281.00	0.05
810	603980	吉华集团	2,700.00	22,275.00	0.05
811	002094	青岛金王	4,640.00	22,272.00	0.05
812	300662	科锐国际	700	22,253.00	0.05
813	600684	珠江实业	5,860.00	22,209.40	0.05

814	002218	拓日新能	7,400.00	22,200.00	0.05
815	300237	美晨生态	8,500.00	22,185.00	0.05
816	002461	珠江啤酒	3,100.00	22,134.00	0.05
817	603387	基蛋生物	960	22,128.00	0.05
818	601789	宁波建工	5,800.00	22,098.00	0.05
819	000058	深赛格	3,000.00	22,050.00	0.05
820	300634	彩讯股份	1,200.00	21,672.00	0.05
821	002519	银河电子	5,510.00	21,599.20	0.05
822	300332	天壕环境	5,300.00	21,571.00	0.05
823	603220	中贝通信	1,000.00	21,490.00	0.05
824	002609	捷顺科技	2,500.00	21,475.00	0.05
825	300765	新诺威	600	21,420.00	0.05
826	002345	潮宏基	5,300.00	21,359.00	0.05
827	002562	兄弟科技	4,360.00	21,276.80	0.05
828	002451	摩恩电气	2,200.00	21,274.00	0.05
829	603595	东尼电子	824	21,267.44	0.05
830	603666	亿嘉和	300	21,240.00	0.05
831	002370	亚太药业	3,300.00	21,219.00	0.05
832	002741	光华科技	1,700.00	21,182.00	0.04
833	000561	烽火电子	2,900.00	21,170.00	0.04
834	002335	科华恒盛	1,300.00	21,151.00	0.04
835	600069	银鸽投资	7,900.00	21,093.00	0.04
836	600467	好当家	8,500.00	21,080.00	0.04
837	300424	航新科技	1,316.00	21,069.16	0.04
838	600686	金龙汽车	3,000.00	21,060.00	0.04
839	600734	实达集团	3,100.00	21,049.00	0.04
840	603590	康辰药业	600	20,952.00	0.04
841	600180	瑞茂通	3,000.00	20,940.00	0.04
842	002631	德尔未来	2,600.00	20,930.00	0.04
843	002141	贤丰控股	5,700.00	20,919.00	0.04
844	000885	城发环境	1,900.00	20,881.00	0.04
845	002776	柏堡龙	2,700.00	20,790.00	0.04
846	002016	世荣兆业	2,400.00	20,784.00	0.04
847	600533	栖霞建设	6,200.00	20,770.00	0.04
847	603218	日月股份	1,000.00	20,770.00	0.04
849	000821	京山轻机	3,200.00	20,768.00	0.04
850	603959	百利科技	2,056.00	20,765.60	0.04
851	603299	苏盐井神	3,000.00	20,730.00	0.04
852	300288	朗玛信息	1,700.00	20,723.00	0.04
853	000545	金浦钛业	6,800.00	20,672.00	0.04
854	600568	中珠医疗	11,800.00	20,650.00	0.04
855	603876	鼎胜新材	1,300.00	20,618.00	0.04

856	000498	山东路桥	4,400.00	20,592.00	0.04
857	600012	皖通高速	3,500.00	20,580.00	0.04
858	000576	广东甘化	2,700.00	20,547.00	0.04
859	002538	司尔特	4,300.00	20,468.00	0.04
860	600242	中昌数据	2,600.00	20,462.00	0.04
861	601015	陕西黑猫	6,365.00	20,368.00	0.04
862	002246	北化股份	2,700.00	20,304.00	0.04
862	603587	地素时尚	800	20,304.00	0.04
864	300364	中文在线	4,919.00	20,217.09	0.04
865	300309	吉艾科技	4,280.00	20,158.80	0.04
866	000019	深粮控股	3,300.00	20,064.00	0.04
867	603713	密尔克卫	500	20,025.00	0.04
868	002833	弘亚数控	500	19,885.00	0.04
869	000557	西部创业	5,700.00	19,665.00	0.04
870	603898	好莱客	1,200.00	19,608.00	0.04
871	603801	志邦家居	840	19,563.60	0.04
872	300531	优博讯	1,200.00	19,512.00	0.04
873	002933	新兴装备	500	19,500.00	0.04
874	603919	金徽酒	1,100.00	19,481.00	0.04
875	603348	文灿股份	800	19,472.00	0.04
876	300064	豫金刚石	5,900.00	19,470.00	0.04
877	601566	九牧王	1,700.00	19,448.00	0.04
878	000905	厦门港务	2,600.00	19,422.00	0.04
879	300262	巴安水务	4,000.00	19,400.00	0.04
880	002516	旷达科技	7,200.00	19,368.00	0.04
881	603808	歌力思	1,300.00	19,331.00	0.04
882	603612	索通发展	1,560.00	19,328.40	0.04
883	600650	锦江投资	1,900.00	19,285.00	0.04
884	000881	中广核技	2,800.00	19,236.00	0.04
885	000791	甘肃电投	5,220.00	19,209.60	0.04
886	000923	河钢资源	1,300.00	19,201.00	0.04
887	300723	一品红	500	19,180.00	0.04
888	601020	华钰矿业	2,100.00	19,173.00	0.04
889	300771	智莱科技	300	19,119.00	0.04
890	300393	中来股份	1,314.00	19,039.86	0.04
891	300439	美康生物	1,400.00	19,026.00	0.04
892	002378	章源钨业	3,600.00	19,008.00	0.04
893	300624	万兴科技	300	18,930.00	0.04
894	002158	汉钟精机	2,100.00	18,732.00	0.04
895	002305	南国置业	8,500.00	18,700.00	0.04
895	603618	杭电股份	3,400.00	18,700.00	0.04
897	603579	荣泰健康	600	18,660.00	0.04

898	002101	广东鸿图	2,600.00	18,564.00	0.04
899	300520	科大国创	1,000.00	18,470.00	0.04
900	600638	新黄浦	2,620.00	18,392.40	0.04
901	300317	珈伟新能	3,825.00	18,360.00	0.04
902	300178	腾邦国际	3,700.00	18,352.00	0.04
903	002232	启明信息	2,100.00	18,249.00	0.04
904	002646	青青稞酒	1,700.00	18,207.00	0.04
905	603896	寿仙谷	600	18,132.00	0.04
906	600295	鄂尔多斯	2,000.00	18,040.00	0.04
907	300533	冰川网络	400	17,932.00	0.04
908	603648	畅联股份	1,800.00	17,928.00	0.04
909	603105	芯能科技	2,500.00	17,875.00	0.04
910	603466	风语筑	1,200.00	17,784.00	0.04
911	600876	洛阳玻璃	1,100.00	17,743.00	0.04
912	300171	东富龙	2,500.00	17,725.00	0.04
913	300307	慈星股份	4,000.00	17,440.00	0.04
914	000517	荣安地产	6,300.00	17,388.00	0.04
915	600619	海立股份	2,100.00	17,325.00	0.04
916	603318	派思股份	1,500.00	17,295.00	0.04
917	002534	杭锅股份	2,200.00	16,984.00	0.04
918	603773	沃格光电	500	16,845.00	0.04
919	002068	黑猫股份	3,500.00	16,835.00	0.04
920	300775	三角防务	500	16,685.00	0.04
921	603728	鸣志电器	1,500.00	16,620.00	0.04
922	600310	桂东电力	3,800.00	16,302.00	0.03
923	300613	富瀚微	100	16,218.00	0.03
924	300740	御家汇	1,700.00	16,133.00	0.03
925	300140	中环装备	1,500.00	16,080.00	0.03
926	002769	普路通	1,899.00	15,970.59	0.03
927	300109	新开源	974	15,944.38	0.03
928	002590	万安科技	2,300.00	15,870.00	0.03
929	300682	朗新科技	700	15,841.00	0.03
930	000965	天保基建	4,980.00	15,836.40	0.03
931	603421	鼎信通讯	900	15,588.00	0.03
932	603626	科森科技	1,480.00	15,377.20	0.03
933	000056	皇庭国际	3,600.00	14,904.00	0.03
934	600618	氯碱化工	2,000.00	14,780.00	0.03
935	603327	福蓉科技	500	14,595.00	0.03
936	300768	迪普科技	400	14,588.00	0.03
937	002759	天际股份	1,600.00	14,560.00	0.03
938	000567	海德股份	1,600.00	14,416.00	0.03
939	000626	远大控股	1,900.00	14,288.00	0.03

940	300011	鼎汉技术	2,400.00	14,184.00	0.03
941	002852	道道全	1,050.00	14,154.00	0.03
942	603777	来伊份	1,200.00	14,124.00	0.03
943	600207	安彩高科	3,000.00	14,010.00	0.03
944	300673	佩蒂股份	500	13,945.00	0.03
945	600290	ST 华仪	4,900.00	13,916.00	0.03
946	001896	豫能控股	3,900.00	13,884.00	0.03
947	600738	兰州民百	2,800.00	13,832.00	0.03
948	300410	正业科技	1,689.00	13,748.46	0.03
949	000514	渝开发	2,900.00	13,659.00	0.03
950	002662	京威股份	5,100.00	13,464.00	0.03
951	603180	金牌厨柜	200	13,356.00	0.03
952	603915	国茂股份	900	13,302.00	0.03
953	000011	深物业 A	1,400.00	13,174.00	0.03
954	300766	每日互动	400	13,124.00	0.03
955	002651	利君股份	2,700.00	13,095.00	0.03
956	002485	希努尔	1,900.00	13,091.00	0.03
957	300278	华昌达	3,000.00	12,870.00	0.03
958	603839	安正时尚	980	12,838.00	0.03
959	603103	横店影视	680	12,790.80	0.03
960	300061	旗天科技	2,000.00	12,760.00	0.03
961	600283	钱江水利	1,200.00	12,552.00	0.03
962	002435	长江健康	3,100.00	12,400.00	0.03
963	002895	川恒股份	1,000.00	12,380.00	0.03
964	002346	柘中股份	1,100.00	12,364.00	0.03
965	300777	中简科技	400	12,352.00	0.03
966	000838	财信发展	3,700.00	11,877.00	0.03
967	603533	掌阅科技	700	11,858.00	0.03
968	603997	继峰股份	1,450.00	11,716.00	0.02
969	002782	可立克	1,100.00	11,671.00	0.02
970	601619	嘉泽新能	3,000.00	11,460.00	0.02
971	603081	大丰实业	700	11,417.00	0.02
972	002656	ST 摩登	2,880.00	11,318.40	0.02
973	300428	四通新材	800	11,248.00	0.02
974	603619	中曼石油	800	11,152.00	0.02
975	002906	华阳集团	900	10,692.00	0.02
976	300674	宇信科技	400	10,540.00	0.02
977	002950	奥美医疗	500	10,425.00	0.02
978	603693	江苏新能	1,000.00	10,180.00	0.02
979	603185	上机数控	400	10,080.00	0.02
980	603098	森特股份	900	9,972.00	0.02
981	603557	起步股份	1,200.00	9,924.00	0.02

982	603013	亚普股份	600	9,216.00	0.02
983	603603	博天环境	1,000.00	9,180.00	0.02
984	002377	国创高新	2,200.00	9,108.00	0.02
985	603900	莱绅通灵	920	8,694.00	0.02
986	002951	金时科技	500	8,650.00	0.02
987	603733	仙鹤股份	600	8,556.00	0.02
988	603279	景津环保	400	8,544.00	0.02
989	300100	双林股份	1,400.00	8,372.00	0.02
990	603555	贵人鸟	1,400.00	8,260.00	0.02
991	002911	佛燃股份	500	7,710.00	0.02
992	603711	香飘飘	300	7,680.00	0.02
993	603687	大胜达	500	7,235.00	0.02
994	600873	梅花生物	1,600.00	7,120.00	0.02
995	603848	好太太	500	6,935.00	0.01
996	603058	永吉股份	900	6,678.00	0.01
997	002907	华森制药	400	6,664.00	0.01
998	603676	卫信康	600	6,366.00	0.01
999	603680	今创集团	510	5,309.10	0.01

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

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	300347	泰格医药	6,950.00	438,892.50	0.93
2	300014	亿纬锂能	5,581.00	279,942.96	0.59
3	300012	华测检测	15,400.00	229,614.00	0.49
4	300285	国瓷材料	7,850.00	179,372.50	0.38
5	300628	亿联网络	2,100.00	152,061.00	0.32
6	601799	星宇股份	1,600.00	151,968.00	0.32
7	600132	重庆啤酒	2,800.00	145,488.00	0.31
8	600728	佳都科技	14,980.00	140,512.40	0.3
9	600446	金证股份	5,900.00	121,422.00	0.26
10	603338	浙江鼎力	1,632.00	116,688.00	0.25
11	600776	东方通信	5,500.00	114,565.00	0.24
12	600273	嘉化能源	10,000.00	112,500.00	0.24
13	300529	健帆生物	1,500.00	107,760.00	0.23
14	603707	健友股份	2,461.00	102,082.28	0.22
15	600675	中华企业	21,200.00	98,580.00	0.21
16	603658	安图生物	1,000.00	96,380.00	0.2
17	300180	华峰超纤	9,850.00	87,074.00	0.18
18	603882	金城医学	1,600.00	81,952.00	0.17
19	002203	海亮股份	6,800.00	69,700.00	0.15
20	000029	深深房 A	6,200.00	68,014.00	0.14

21	000967	盈峰环境	10,992.00	67,820.64	0.14
22	002867	周大生	2,500.00	47,600.00	0.1
23	002653	海思科	1,900.00	38,684.00	0.08
24	002003	伟星股份	6,100.00	37,332.00	0.08
25	300465	高伟达	3,580.00	36,122.20	0.08
26	603699	纽威股份	2,600.00	35,932.00	0.08
27	000731	四川美丰	6,800.00	35,428.00	0.08
28	300231	银信科技	4,100.00	34,235.00	0.07
29	601388	怡球资源	16,380.00	31,613.40	0.07
30	002540	亚太科技	7,400.00	31,524.00	0.07
31	002448	中原内配	5,600.00	30,016.00	0.06
32	002253	川大智胜	2,050.00	29,622.50	0.06
33	000407	胜利股份	8,200.00	29,192.00	0.06
34	600661	昂立教育	1,700.00	29,189.00	0.06
35	002362	汉王科技	1,800.00	28,764.00	0.06
36	002453	华软科技	5,300.00	28,726.00	0.06
37	300050	世纪鼎利	5,000.00	28,400.00	0.06
38	600856	ST 中天	11,100.00	27,861.00	0.06
39	603003	龙宇燃油	3,400.00	27,608.00	0.06
40	601599	鹿港文化	8,300.00	27,556.00	0.06
41	002321	华英农业	4,900.00	27,391.00	0.06
42	300157	恒泰艾普	6,600.00	26,862.00	0.06
43	002554	惠博普	8,700.00	26,448.00	0.06
44	300304	云意电气	6,000.00	26,400.00	0.06
45	600630	龙头股份	3,400.00	25,806.00	0.05
46	000631	顺发恒业	8,400.00	25,704.00	0.05
47	002329	皇氏集团	5,840.00	25,696.00	0.05
48	600173	卧龙地产	4,900.00	25,529.00	0.05
49	300173	智慧松德	3,400.00	25,092.00	0.05
50	002543	万和电气	2,613.00	25,006.41	0.05
51	603385	惠达卫浴	2,160.00	24,861.60	0.05
52	300432	富临精工	2,000.00	24,780.00	0.05
53	000558	莱茵体育	7,500.00	24,750.00	0.05
54	002178	延华智能	5,800.00	24,302.00	0.05
55	000837	秦川机床	5,600.00	23,968.00	0.05
56	002033	丽江旅游	3,790.00	23,687.50	0.05
57	000673	当代东方	4,600.00	23,460.00	0.05
58	600501	航天晨光	2,900.00	22,649.00	0.05
59	002716	ST 金贵	7,820.00	22,443.40	0.05
60	300008	天海防务	7,750.00	22,397.50	0.05
61	002502	鼎龙文化	7,000.00	22,260.00	0.05
62	600303	曙光股份	6,300.00	22,176.00	0.05
63	000151	中成股份	2,100.00	22,050.00	0.05

64	300625	三雄极光	1,300.00	21,216.00	0.05
65	002584	西陇科学	4,100.00	20,828.00	0.04
66	002658	雪迪龙	2,800.00	20,272.00	0.04
67	002972	科安达	994	19,909.82	0.04
68	300485	赛升药业	2,200.00	19,822.00	0.04
69	603999	读者传媒	2,700.00	19,818.00	0.04
70	601500	通用股份	3,000.00	19,530.00	0.04
71	300097	智云股份	2,000.00	19,020.00	0.04
72	002418	康盛股份	6,600.00	18,876.00	0.04
73	601113	ST 华鼎	5,400.00	18,468.00	0.04
74	603010	万盛股份	1,620.00	18,322.20	0.04
75	603730	岱美股份	600	18,126.00	0.04
76	002752	昇兴股份	2,900.00	17,806.00	0.04
77	300242	佳云科技	4,400.00	17,776.00	0.04
78	300221	银禧科技	3,100.00	17,701.00	0.04
79	603303	得邦照明	1,700.00	17,527.00	0.04
80	002349	精华制药	3,900.00	17,472.00	0.04
81	603126	中材节能	3,500.00	17,150.00	0.04
82	300511	雪榕生物	2,510.00	16,992.70	0.04
83	002577	雷柏科技	1,300.00	16,705.00	0.04
84	603358	华达科技	1,076.00	15,914.04	0.03
85	603843	正平股份	3,260.00	15,256.80	0.03
86	300426	唐德影视	2,400.00	14,928.00	0.03
87	300660	江苏雷利	908	14,555.24	0.03
88	600381	青海春天	2,700.00	14,553.00	0.03
89	002287	奇正藏药	649	14,128.73	0.03
90	002247	聚力文化	4,900.00	13,916.00	0.03
91	300447	全信股份	1,380.00	13,468.80	0.03
92	601882	海天精工	1,800.00	13,050.00	0.03
93	600781	ST 辅仁	2,200.00	12,782.00	0.03
94	603055	台华新材	1,760.00	12,020.80	0.03
95	300528	幸福蓝海	1,740.00	11,797.20	0.03
96	300431	暴风集团	3,060.00	11,169.00	0.02
97	300518	盛讯达	400	10,912.00	0.02
98	300512	中亚股份	900	10,332.00	0.02
99	603165	荣晟环保	600	10,152.00	0.02
100	603277	银都股份	900	9,666.00	0.02
101	603339	四方科技	700	9,492.00	0.02
102	603109	神驰机电	357	9,449.79	0.02
103	603861	白云电器	1,000.00	8,730.00	0.02
104	002973	侨银环保	1,146.00	6,578.04	0.01

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	307,194.00	0.76
2	002405	四维图新	260,324.00	0.65
3	600989	宝丰能源	212,158.48	0.53
4	300450	先导智能	210,896.89	0.52
5	600635	大众公用	162,150.00	0.40
6	300782	卓胜微	144,944.38	0.36
7	000540	中天金融	136,175.00	0.34
8	600776	东方通信	129,354.00	0.32
9	300676	华大基因	96,602.00	0.24
10	600601	方正科技	92,568.00	0.23
11	002123	梦网集团	92,165.00	0.23
12	000667	美好置业	84,281.00	0.21
13	600366	宁波韵升	80,640.00	0.20
14	002332	仙琚制药	76,706.00	0.19
15	002955	鸿合科技	74,838.77	0.19
16	600503	华丽家族	74,239.00	0.18
17	300401	花园生物	72,324.00	0.18
18	600736	苏州高新	71,563.00	0.18
19	600864	哈投股份	71,242.00	0.18
20	600936	广西广电	67,450.00	0.17

注：买入金额不包括相关交易费用。

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	000977	浪潮信息	319,410.00	0.79
2	002157	正邦科技	287,704.00	0.72
3	600989	宝丰能源	240,013.82	0.60
4	600763	通策医疗	218,981.00	0.54
5	300601	康泰生物	217,956.45	0.54
6	002821	凯莱英	196,873.40	0.49
7	600745	闻泰科技	183,903.00	0.46
8	300009	安科生物	143,870.04	0.36
9	600486	扬农化工	139,861.00	0.35
10	601236	红塔证券	136,431.77	0.34
11	600873	梅花生物	134,982.00	0.34

12	300207	欣旺达	127,673.00	0.32
13	603939	益丰药房	121,707.00	0.30
14	600845	宝信软件	116,359.00	0.29
15	000883	湖北能源	116,217.00	0.29
16	002958	青农商行	111,694.08	0.28
17	603517	绝味食品	109,519.80	0.27
18	002812	恩捷股份	100,688.00	0.25
19	000301	东方盛虹	95,259.00	0.24
20	300759	康龙化成	86,806.69	0.22

注：卖出金额不包括相关交易费用。

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	15,644,575.27
卖出股票收入（成交）总额	20,850,016.20

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

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	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）	4,294.56	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,294.56	0.01

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	占基金资产净值比例（%）
1	128062	亚药转债	48	4,294.56	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

本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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
1	存出保证金	1,145.30
2	应收证券清算款	525,551.83
3	应收股利	-
4	应收利息	597.65
5	应收申购款	12,079.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	539,374.14

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128062	亚药转债	4,294.56	0.01

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的说明

本基金本报告期末前十名指数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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

1000A	54	32,114.43	1,417,560.00	81.74	316,619.00	18.26
1000B	268	6,470.82	145.00	0.01	1,734,034.00	99.99
华宝 中证 1000 指数 分级	3,992	13,501.47	513,905.87	0.95	53,383,975.12	99.05
合计	4,314	13,297.69	1,931,610.87	3.37	55,434,628.12	96.63

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	新华人寿保险股份有限公司	1,417,560.00	81.74
2	陈丹华	81,664.00	4.71
3	施鸿宇	37,000.00	2.13
4	曹蜀湘	31,200.00	1.80
5	唐梦雪	29,000.00	1.67
6	高明桂	22,957.00	1.32
7	吴益群	17,247.00	0.99
8	张志赟	17,241.00	0.99
9	梁小红	14,059.00	0.81
10	郭国棠	12,851.00	0.74

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	朱金元	340,790.00	19.65
2	丁建英	166,824.00	9.62
3	祝东华	106,463.00	6.14
4	曹国安	56,400.00	3.25
5	郑昕沂	52,400.00	3.02
6	姚绿绿	48,000.00	2.77
7	刘娟	46,066.00	2.66
8	谢锦星	44,722.00	2.58
9	杨玉锋	42,314.00	2.44
10	刘文卿	35,311.00	2.04

华宝中证 1000 指数分级

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
----	------	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝中证 1000 指数分级	6,491.75	0.0120
	合计	6,491.75	0.0113

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝中证 1000 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝中证 1000 指数分级	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日）基金份额总额	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
本报告期期初基金份额总额	1,598,464.00	1,598,464.00	56,983,722.42
本报告期基金总申购份额	-	-	17,814,783.06
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	22,558,245.72
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	135,715.00	135,715.00	1,657,621.23
本报告期末基金份额总额	1,734,179.00	1,734,179.00	53,897,880.99

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

1、基金管理人的重大人事变动

基金管理人于 2019 年 10 月 26 日发布《华宝基金管理有限公司关于公司督察长变更公告》，自 2019 年 10 月 25 日起，刘月华不再担任公司督察长职务，由公司总经理黄小慧代行督察长职务。

基金管理人于 2019 年 10 月 26 日发布《华宝基金管理有限公司关于公司副总经理变更公告》，自 2019 年 10 月 25 日起，欧江洪不再担任公司副总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2019 年 11 月 20 日起更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 20,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本报告期。

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

1、2019 年 10 月，基金管理人收到中国证监会上海监管局《关于对华宝基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，并对公司相关责任人员采取出具警示函的措施。公司高度重视并逐一落实各项整改要求，进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2020 年 1 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

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

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	
中信证券	2	8,423,648.27	23.98%	7,845.08	24.20%	-
中泰证券	2	7,241,434.27	20.61%	6,599.05	20.35%	-
东方证券	2	6,200,161.67	17.65%	5,774.31	17.81%	-
天风证券	2	3,660,622.17	10.42%	3,335.78	10.29%	-
国泰君安	2	1,631,071.94	4.64%	1,512.42	4.67%	-
国信证券	1	1,618,317.49	4.61%	1,506.91	4.65%	-
广发证券	2	1,586,829.13	4.52%	1,478.13	4.56%	-
申万宏源	2	787,531.50	2.24%	733.27	2.26%	-
中信建投	1	686,442.18	1.95%	625.54	1.93%	-
东吴证券	1	536,533.12	1.53%	499.63	1.54%	-
海通证券	1	362,169.61	1.03%	337.28	1.04%	-
中投证券	1	318,381.04	0.91%	296.53	0.91%	-
华宝证券	1	265,450.91	0.76%	247.24	0.76%	-
民生证券	1	247,231.00	0.70%	230.33	0.71%	-
招商证券	2	239,305.85	0.68%	218.07	0.67%	-
西部证券	1	224,107.77	0.64%	159.41	0.49%	-
红塔证券	1	222,556.00	0.63%	207.33	0.64%	-
中金国际	1	200,251.00	0.57%	186.39	0.57%	-
安信证券	1	155,079.00	0.44%	144.40	0.45%	-
银河证券	1	141,267.00	0.40%	131.58	0.41%	-
川财证券	1	123,030.00	0.35%	114.64	0.35%	-

长江证券	1	98,325.02	0.28%	91.59	0.28%	-
万联证券	1	62,771.40	0.18%	57.20	0.18%	-
瑞银证券	1	50,432.17	0.14%	46.96	0.14%	-
太平洋证券	2	27,747.52	0.08%	25.29	0.08%	-
光大证券	1	17,061.98	0.05%	15.89	0.05%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，

各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司新增交易单元：华西证券；退租交易单元：申万宏源西部证券。

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019-01-01
2	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京百度百盈基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-01-10
3	华宝中证 1000 指数分级证券投资基	证券日报及基金管理人	2019-01-15

	金招募说明书（更新）摘要	网站	
4	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019-01-15
5	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-01-18
6	华宝基金管理有限公司关于参加宜信普泽（北京）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2019-01-18
7	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券日报及基金管理人网站	2019-01-21
8	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-02-01
9	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-02-22
10	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-21
11	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年度报告	基金管理人网站	2019-03-30
12	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年度报告（摘要）	证券日报及基金管理人网站	2019-03-30
13	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-09
14	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-12
15	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金恢复场外大额申购（含定期定额投资）业务、暂停场内申购业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-13
16	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-17
17	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-19
18	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-20
19	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-04-25
20	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-05-08

21	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-05-14
22	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-05-17
23	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-05-22
24	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-05-25
25	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-05-30
26	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-06-06
27	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-06-12
28	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-12
29	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-06-18
30	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-22
31	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019-06-30
32	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-07-02
33	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	证券日报及基金管理人网站	2019-07-17
34	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券日报及基金管理人网站	2019-07-18
35	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019-07-18
36	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-07-18
37	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-07-26
38	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-08-09
39	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-08-15
40	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告	基金管理人网站	2019-08-29
41	华宝中证 1000 指数分级证券投资基	证券日报及基金管理人	2019-08-29

	金 2019 年半年度报告（摘要）	网站	
42	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-09-04
43	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-09-21
44	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-10-09
45	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	证券日报及基金管理人网站	2019-10-22
46	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2019-11-02
47	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金更换会计师事务所的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-11-21
48	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2019-11-30
49	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2019-11-30
50	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	基金管理人网站	2019-11-30
51	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2019-11-30
52	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-11-30
53	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-12-10
54	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-12-10
55	关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 1000A 停复牌的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-12-16
56	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-12-17
57	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000A 份额定期份额折算后前收盘价调整的公告	证券日报及基金管理人网站	2019-12-17

§ 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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 11 月 30 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同的公告》，公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

基金管理人于 2019 年 10 月 26 日发布《华宝基金管理有限公司关于公司督察长变更公告》，自 2019 年 10 月 25 日起，刘月华不再担任公司督察长职务，由公司总经理黄小蕙代行督察长职务。

基金管理人于 2019 年 10 月 26 日发布《华宝基金管理有限公司关于公司副总经理变更公告》，自 2019 年 10 月 25 日起，欧江洪不再担任公司副总经理职务。

基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同；
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书；
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

13.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各项

种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2020 年 3 月 30 日