

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 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 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	71

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	71
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 市场中性策略执行情况	72
7.13 投资组合报告附注	72
§ 8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末上市基金前十名持有人	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	74
§ 9 开放式基金份额变动	75
§ 10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8 其他重大事件	80
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	81

§ 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	50,386,490.67 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 8 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	1,562,135.00 份	1,562,135.00 份	47,262,220.67 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

	<p>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。</p> <p>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实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。</p>		
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	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、021-38924558	021-60637111
传真		021-38505777	021-60635778
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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com

基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	-976,837.26
本期利润	6,600,544.64
加权平均基金份额本期利润	0.1225
本期加权平均净值利润率	14.15%
本期基金份额净值增长率	15.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-85,335,541.52
期末可供分配基金份额利润	-1.6936
期末基金资产净值	47,645,503.31
期末基金份额净值	0.9456
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-60.43%

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

2、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）

3、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。

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

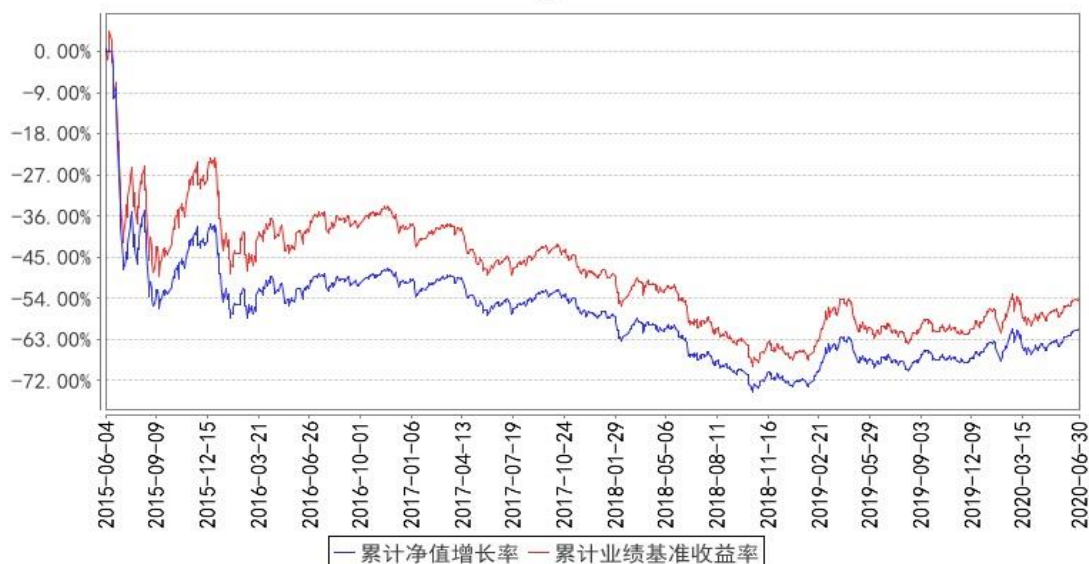
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.80%	0.82%	8.21%	0.85%	0.59%	-0.03%

过去三个月	17.12%	1.15%	15.59%	1.17%	1.53%	-0.02%
过去六个月	15.08%	1.77%	12.92%	1.79%	2.16%	-0.02%
过去一年	21.22%	1.46%	17.93%	1.48%	3.29%	-0.02%
过去三年	-12.02%	1.44%	-14.24%	1.46%	2.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-60.43%	1.81%	-53.58%	1.83%	-6.85%	-0.02%

注：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。

§ 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（2020 年 6 月 30 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)、华宝成长策略混合型证券投资基金、华宝红利精选混合型证券投资基金。

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		
张奇	本基金的基金经理助理、华宝红利精选混合基金经理	2017 年 4 月 6 日	2020 年 6 月 23 日	9	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。2015 年 4 月至 2020 年 6 月任上证 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投资基金基金经理助理。2017 年 4 月至 2020 年 6 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理助理。2018 年 11 月 2020 年 6 月任华宝中证银行交

					易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2019 年 1 月 2020 年 6 月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。2020 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理。
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	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、基金经理等职务。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 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。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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

资产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。

4.3.2 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

2020 年上半年受到国内国际新冠肺炎疫情相继爆发蔓延，市场一季度出现明显波动，在春节后第一天大跌后，2 月份市场走出修复行情，在市场热度逐渐升温的过程中，小盘股受到资金的边际参与，走出了一波反弹行情，创出阶段性高点，3 月中下旬受海外疫情扩散的影响，A 股开始整体下跌，在二季度开始稳步走强过程中以中证 1000 为代表的中小市值指数表现良好。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 15.08%，业绩比较基准收益率为 12.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

面对疫情后周期保增长保就业保民生的现实需求，预计下半年积极的财政政策更加积极有为，稳健的货币政策保证针对性和实效性，在执行过程中更具有灵活性。随着创业板注册制的推出，市场的活力和热度有望进一步激发，以中证 1000 为代表的小盘股可能受益于市场热度回升带来流动性改善。我们认为中证 1000 指数作为小盘股的基准指数，具有重要且独特的配置价值。

作为指数基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，实现对指数的有效跟踪。

4.6 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、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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2020年6月30日，本基金基金资产净值已连续超过六十个工作日低于五千万元。根据相关规定，基金管理人已上报变更注册方案并计划召开

基金份额持有人大会，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,026,941.26	2,706,235.67
结算备付金		1,904.19	-
存出保证金		1,626.67	1,145.30
交易性金融资产	6.4.7.2	45,006,375.07	44,173,304.38
其中：股票投资		45,006,375.07	44,169,009.82

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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	525,551.83
应收利息	6.4.7.5	624.93	597.65
应收股利		-	-
应收申购款		-	12,079.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		48,037,472.12	47,418,914.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		208,044.99	97,574.29
应付管理人报酬		38,435.87	39,237.02
应付托管费		8,455.87	8,632.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	22,158.34	13,140.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,873.74	120,254.65
负债合计		391,968.81	278,838.37
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	120,419,917.93	137,101,021.14
未分配利润	6.4.7.10	-72,774,414.62	-89,960,945.32
所有者权益合计		47,645,503.31	47,140,075.82
负债和所有者权益总计		48,037,472.12	47,418,914.19

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 50386490.67 份，其中 1000A 基金份额总额 1,562,135.00，基金份额净值 1.0301；1000B 基金份额总额 1,562,135.00，基金份额净值 0.8611；华宝中证 1000 指数分级基金份额总额 47,262,220.67，基金份额净值 0.9456。

6.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		7,092,674.51	9,159,456.85
1. 利息收入		10,402.21	12,336.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,401.93	12,333.32
债券利息收入		0.28	2.84
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）		-500,443.93	-2,953,477.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-780,977.11	-3,303,910.11
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-492.72	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	281,025.90	350,432.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,577,381.90	12,084,225.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,334.33	16,372.33
减：二、费用		492,129.87	492,703.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	231,846.64	238,890.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,006.28	52,555.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	44,264.19	32,545.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	165,012.76	168,711.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,600,544.64	8,666,753.60

减：所得税费用		-	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,600,544.64	8,666,753.60

6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	137,101,021.14	-89,960,945.32	47,140,075.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,600,544.64	6,600,544.64
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）	-16,681,103.21	10,585,986.06	-6,095,117.15
其中：1. 基金申购款	5,119,147.94	-3,269,660.67	1,849,487.27
2. 基金赎回款	-21,800,251.15	13,855,646.73	-7,944,604.42
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）	120,419,917.93	-72,774,414.62	47,645,503.31
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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	-	8,666,753.60	8,666,753.60

利润)			
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)	-737,003.89	200,403.34	-536,600.55
其中：1. 基金申购款	33,759,634.83	-22,726,022.76	11,033,612.07
2. 基金赎回款	-34,496,638.72	22,926,426.10	-11,570,212.62
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)	148,034,289.42	-99,717,802.79	48,316,486.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

本基金的财务报表于 2020 年 8 月 31 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,026,941.26
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	3,026,941.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	48,983,416.90	45,006,375.07	-3,977,041.83
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	48,983,416.90	45,006,375.07	-3,977,041.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	623.43
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	0.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.70
合计	624.93

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	22,158.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	22,158.34

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	230.98

应付证券出借违约金	-
预提费用	64,642.76
应付指数使用费	50,000.00
合计	114,873.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,366,238.99	137,101,021.14
本期申购	2,141,993.24	5,119,147.94
本期赎回（以“-”号填列）	-9,121,741.56	-21,800,251.15
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	50,386,490.67	120,419,917.93

注：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。

6.4.7.10 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	-96,177,604.95	6,216,659.63	-89,960,945.32
本期利润	-976,837.26	7,577,381.90	6,600,544.64
本期基金份额交易产生的变动数	11,818,900.69	-1,232,914.63	10,585,986.06
其中：基金申购款	-3,629,791.91	360,131.24	-3,269,660.67
基金赎回款	15,448,692.60	-1,593,045.87	13,855,646.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-85,335,541.52	12,561,126.90	-72,774,414.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
	活期存款利息收入
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	106.33
其他	23.42
合计	10,401.93

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-780,977.11
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-780,977.11

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	16,893,263.90
减：卖出股票成本总额	17,674,241.01
买卖股票差价收入	-780,977.11

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-492.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-492.72

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,316.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,800.00
减：应收利息总额	8.93
买卖债券差价收入	-492.72

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	281,025.90
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	281,025.90

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	7,577,381.90
股票投资	7,576,876.46
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	7,577,381.90

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,334.33
合计	5,334.33

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	44,264.19
银行间市场交易费用	-
合计	44,264.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	370.00
指数使用费	100,000.00
上市费	29,835.26
合计	165,012.76

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华宝证券	508,614.84	1.87	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华宝证券	473.52	1.90	473.52	2.14
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	231,846.64	238,890.75
其中：支付销售机构的客户维护 费	93,286.36	94,314.06

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,006.28	52,555.95

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,026,941.26	10,272.18	2,897,112.69	12,126.76

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年07月08日	新股流通受限	5.94	5.94	841	4,995.54	4,995.54	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年07月03日	新股流通受限	17.63	17.63	392	6,910.96	6,910.96	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600185	格力地产	2020年06月30日	重大事项	11.61	2020年07月01日	12.77	12,080	83,099.95	140,248.80	-
000029	深深房A	2016年09月14日	重大事项	10.81	-	-	6,200	81,266.58	67,022.00	-
002254	泰和新材	2020年6月29日	重大事项	13.60	2020年07月14日	14.96	4,100	42,698.32	55,760.00	-
600226	*ST瀚叶	2020年4月30日	重大事项	2.35	2020年7月1日	2.23	19,206	98,502.19	45,134.10	-
000597	东北制药	2020年6月24日	重大事项	5.22	2020年7月	5.37	6,500	33,177.18	33,930.00	-

		日			1 日						
600090	*ST 济堂	2020 年 06 月 30 日	重大事项	2.90	2020 年 07 月 01 日	2.76	8,400	68,790.95	24,360.00	-	
600242	*ST 中昌	2020 年 06 月 30 日	重大事项	6.35	2020 年 07 月 01 日	6.03	2,700	22,302.00	17,145.00	-	
000662	*ST 天夏	2020 年 6 月 30 日	重大事项	2.48	2020 年 7 月 1 日	2.36	6,400	31,621.41	15,872.00	-	
002638	*ST 勤上	2020 年 6 月 30 日	重大事项	2.10	2020 年 7 月 1 日	2.00	6,650	50,811.82	13,965.00	-	
600069	*ST 银鸽	2020 年 6 月 10 日	重大事项	0.92	2020 年 07 月 10 日	0.83	8,300	41,707.82	7,636.00	-	

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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此限定的范围之内，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公司在经营管理和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通过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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无

6.4.13.3 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。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,026,941.26	-	-	-	3,026,941.26
结算备付金	1,904.19	-	-	-	1,904.19
存出保证金	1,626.67	-	-	-	1,626.67
交易性金融资产	-	-	-	45,006,375.07	45,006,375.07
应收利息	-	-	-	624.93	624.93

资产总计	3,030,472.12	-	-	45,007,000.00	48,037,472.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	208,044.99	208,044.99
应付管理人报酬	-	-	-	38,435.87	38,435.87
应付托管费	-	-	-	8,455.87	8,455.87
应付交易费用	-	-	-	22,158.34	22,158.34
其他负债	-	-	-	114,873.74	114,873.74
负债总计	-	-	-	391,968.81	391,968.81
利率敏感度缺口	3,030,472.12	-	-	44,615,031.19	47,645,503.31
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	45,006,375.07	94.46	44,169,009.82	93.70
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	45,006,375.07	94.46	44,169,009.82	93.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
	对资产负债表日基金资产净值的

	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,349,157.25	2,306,706.51
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,349,157.25	-2,306,706.51

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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 44,983,139.59 元，属于第二层次的余额为 23,235.48 元，无属于第三层次的余额（于上年度末：第一层次 44,007,129.78 元，第二层次 166,174.60 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(于上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	45,006,375.07	93.69
	其中：股票	45,006,375.07	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,028,845.45	6.31
8	其他各项资产	2,251.60	0.00
9	合计	48,037,472.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	410,443.50	0.86
B	采矿业	847,762.54	1.78
C	制造业	28,262,184.20	59.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	935,833.50	1.96
E	建筑业	1,029,685.41	2.16
F	批发和零售业	1,606,136.18	3.37
G	交通运输、仓储	867,906.56	1.82

	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	5,979,559.92	12.55
J	金融业	513,220.80	1.08
K	房地产业	1,412,602.79	2.96
L	租赁和商务服务业	528,466.88	1.11
M	科学研究和技术服务业	848,497.28	1.78
N	水利、环境和公共设施管理业	775,740.96	1.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,156.80	0.04
Q	卫生和社会工作	128,200.24	0.27
R	文化、体育和娱乐业	447,555.60	0.94
S	综合	182,915.70	0.38
	合计	44,795,868.86	94.02

7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	118,537.46	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,096.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,722.43	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	67,022.00	0.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术	-	-

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	7,128.00	0.01
	合计	210,506.21	0.44

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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	300661	圣邦股份	880	268,444.00	0.56
2	300676	华大基因	1,500	233,865.00	0.49
3	002065	东华软件	18,000	225,360.00	0.47
4	300463	迈克生物	3,600	209,628.00	0.44
5	300326	凯利泰	6,800	197,880.00	0.42
6	300724	捷佳伟创	1,800	159,354.00	0.33
7	000799	酒鬼酒	2,000	153,020.00	0.32
8	603005	晶方科技	1,900	149,454.00	0.31
9	002436	兴森科技	11,600	148,828.00	0.31
10	300699	光威复材	2,360	148,042.80	0.31
11	002402	和而泰	8,950	145,079.50	0.30
12	002683	宏大爆破	4,100	143,090.00	0.30
13	002400	省广集团	13,600	142,664.00	0.30
14	600185	格力地产	12,080	140,248.80	0.29
15	600984	建设机械	5,500	136,400.00	0.29
16	300502	新易盛	2,160	136,339.20	0.29
17	300451	创业慧康	7,275	134,514.75	0.28
18	000540	中天金融	40,600	130,732.00	0.27
19	603345	安井食品	1,100	129,800.00	0.27
20	300223	北京君正	1,260	127,184.40	0.27
21	002123	梦网集团	6,400	126,720.00	0.27
22	300037	新宙邦	2,300	126,638.00	0.27
23	000710	贝瑞基因	2,100	125,454.00	0.26

24	002481	双塔食品	7,200	124,704.00	0.26
25	300457	赢合科技	3,825	121,941.00	0.26
26	300346	南大光电	2,800	120,736.00	0.25
27	002409	雅克科技	2,300	119,991.00	0.25
28	002332	仙琚制药	7,100	119,564.00	0.25
29	002100	天康生物	7,300	117,530.00	0.25
30	300379	东方通	2,700	116,181.00	0.24
31	300598	诚迈科技	600	113,640.00	0.24
32	300226	上海钢联	1,443	113,419.80	0.24
33	002791	坚朗五金	1,200	112,908.00	0.24
34	600882	妙可蓝多	3,100	112,499.00	0.24
35	300073	当升科技	3,400	112,438.00	0.24
36	600988	赤峰黄金	9,400	111,860.00	0.23
37	603708	家家悦	2,268	111,721.68	0.23
38	002675	东诚药业	5,300	111,035.00	0.23
39	600641	万业企业	4,700	110,450.00	0.23
40	300054	鼎龙股份	6,640	110,224.00	0.23
41	002705	新宝股份	3,000	109,440.00	0.23
42	603520	司太立	1,300	109,278.00	0.23
43	002568	百润股份	2,400	108,768.00	0.23
44	300036	超图软件	4,300	108,274.00	0.23
45	300369	绿盟科技	4,600	107,134.00	0.22
46	300476	胜宏科技	4,420	106,301.00	0.22
47	600305	恒顺醋业	5,616	104,176.80	0.22
48	603456	九洲药业	3,800	102,980.00	0.22
49	000818	航锦科技	4,600	102,718.00	0.22
50	600812	华北制药	7,900	101,831.00	0.21
51	002214	大立科技	3,600	101,448.00	0.21
52	002727	一心堂	2,700	100,197.00	0.21
53	300674	宇信科技	2,300	99,245.00	0.21
54	300236	上海新阳	1,650	99,099.00	0.21
55	603027	千禾味业	3,120	98,529.60	0.21
56	600720	祁连山	6,000	97,500.00	0.20
57	603881	数据港	900	97,263.00	0.20
58	000403	双林生物	1,300	96,369.00	0.20
59	600323	瀚蓝环境	4,400	96,272.00	0.20
60	002425	凯撒文化	5,480	96,228.80	0.20
61	600873	梅花生物	21,100	95,794.00	0.20
62	300567	精测电子	1,400	95,550.00	0.20
63	002126	银轮股份	7,700	94,248.00	0.20
64	603686	龙马环卫	3,860	94,068.20	0.20
65	300188	美亚柏科	4,700	93,201.00	0.20

66	601636	旗滨集团	15,700	92,944.00	0.20
67	002151	北斗星通	2,900	92,887.00	0.19
68	300747	锐科激光	850	92,505.50	0.19
69	000034	神州数码	3,800	92,492.00	0.19
70	002467	二六三	13,130	92,303.90	0.19
71	002647	仁东控股	2,600	92,248.00	0.19
72	000672	上峰水泥	3,900	92,079.00	0.19
73	002351	漫步者	4,350	91,872.00	0.19
74	002025	航天电器	2,500	91,450.00	0.19
75	002581	未名医药	3,200	91,232.00	0.19
76	002216	三全食品	3,800	90,820.00	0.19
77	002023	海特高新	5,900	90,683.00	0.19
78	603737	三棵树	980	90,375.60	0.19
79	002036	联创电子	7,223	90,287.50	0.19
80	300348	长亮科技	4,750	90,250.00	0.19
81	000735	罗牛山	8,800	90,112.00	0.19
82	300363	博腾股份	2,600	89,856.00	0.19
83	300770	新媒股份	400	89,464.00	0.19
84	300725	药石科技	720	89,460.00	0.19
85	002643	万润股份	5,200	89,284.00	0.19
86	300685	艾德生物	1,160	89,273.60	0.19
87	300118	东方日升	5,900	88,500.00	0.19
88	002706	良信电器	5,300	88,404.00	0.19
89	300078	思创医惠	6,524	88,269.72	0.19
90	300294	博雅生物	2,350	88,101.50	0.18
91	300766	每日互动	2,300	87,538.00	0.18
92	300526	中潜股份	700	86,940.00	0.18
93	600252	中恒集团	26,900	86,349.00	0.18
94	300298	三诺生物	2,680	86,135.20	0.18
95	002497	雅化集团	9,300	85,839.00	0.18
96	600635	大众公用	18,800	85,728.00	0.18
97	000035	中国天楹	16,800	85,680.00	0.18
98	002697	红旗连锁	7,840	85,612.80	0.18
99	600459	贵研铂业	2,850	84,958.50	0.18
100	603638	艾迪精密	1,613	84,521.20	0.18
101	600546	山煤国际	7,100	83,425.00	0.18
102	300098	高新兴	13,763	83,403.78	0.18
103	002063	远光软件	6,600	83,358.00	0.17
104	002413	雷科防务	10,700	82,176.00	0.17
105	002912	中新赛克	500	81,795.00	0.17
106	600797	浙大网新	9,900	81,576.00	0.17
107	002262	恩华药业	4,836	81,534.96	0.17

108	000951	中国重汽	2,600	81,276.00	0.17
109	600206	有研新材	5,800	81,026.00	0.17
110	600267	海正药业	5,600	80,360.00	0.17
111	600966	博汇纸业	7,800	79,170.00	0.17
112	000733	振华科技	3,500	78,715.00	0.17
113	600702	舍得酒业	2,100	78,435.00	0.16
114	601519	大智慧	9,700	78,182.00	0.16
115	000503	国新健康	7,000	77,980.00	0.16
116	603127	昭衍新药	740	77,796.20	0.16
117	300666	江丰电子	1,300	77,584.00	0.16
118	600330	天通股份	7,780	77,566.60	0.16
119	600621	华鑫股份	4,000	77,200.00	0.16
120	300373	扬杰科技	2,300	77,096.00	0.16
121	300709	精研科技	800	76,920.00	0.16
122	600491	龙元建设	8,900	76,896.00	0.16
123	300352	北信源	10,775	75,963.75	0.16
124	002310	东方园林	15,700	75,831.00	0.16
125	002597	金禾实业	3,300	75,801.00	0.16
126	300395	菲利华	2,300	75,601.00	0.16
127	300702	天宇股份	700	74,424.00	0.16
128	002099	海翔药业	9,400	74,354.00	0.16
129	600517	国网英大	11,100	74,148.00	0.16
130	002389	航天彩虹	5,500	73,975.00	0.16
131	600211	西藏药业	1,160	73,915.20	0.16
132	600559	老白干酒	5,705	73,879.75	0.16
133	603039	泛微网络	956	73,860.56	0.16
134	300458	全志科技	2,006	73,820.80	0.15
135	000016	深康佳 A	10,900	73,684.00	0.15
136	002326	永太科技	5,996	73,510.96	0.15
137	000851	高鸿股份	8,800	72,776.00	0.15
138	300031	宝通科技	2,900	72,616.00	0.15
139	300573	兴齐眼药	500	72,500.00	0.15
140	002237	恒邦股份	5,300	72,451.00	0.15
141	000555	神州信息	4,700	72,286.00	0.15
142	002106	莱宝高科	5,500	72,270.00	0.15
143	002605	姚记科技	1,900	72,200.00	0.15
144	300659	中孚信息	1,200	72,024.00	0.15
145	002022	科华生物	4,000	71,800.00	0.15
146	300394	天孚通信	1,200	71,460.00	0.15
147	603678	火炬电子	2,550	71,451.00	0.15
148	000903	云内动力	13,200	71,016.00	0.15
149	300233	金城医药	2,300	70,725.00	0.15

150	603596	伯特利	2,000	70,400.00	0.15
151	600601	方正科技	21,300	70,077.00	0.15
152	300572	安车检测	1,100	69,905.00	0.15
153	002251	步步高	5,000	69,900.00	0.15
154	300792	壹网壹创	400	69,664.00	0.15
155	000917	电广传媒	11,000	69,520.00	0.15
156	600711	盛屯矿业	13,500	69,390.00	0.15
157	300132	青松股份	3,000	69,300.00	0.15
158	000591	太阳能	20,460	69,154.80	0.15
159	300737	科顺股份	3,500	69,055.00	0.14
160	002851	麦格米特	2,650	68,688.00	0.14
161	002035	华帝股份	6,730	68,174.90	0.14
162	300397	天和防务	2,780	67,859.80	0.14
163	300456	赛微电子	2,440	67,392.80	0.14
164	600246	万通地产	8,000	67,120.00	0.14
165	600131	国网信通	3,500	66,395.00	0.14
166	300170	汉得信息	6,900	66,378.00	0.14
167	000667	美好置业	24,000	66,240.00	0.14
168	300079	数码科技	13,900	66,025.00	0.14
169	002079	苏州固锝	5,000	65,850.00	0.14
170	300083	劲胜智能	11,100	65,712.00	0.14
171	000582	北部湾港	6,100	65,514.00	0.14
172	600993	马应龙	2,700	65,475.00	0.14
173	000831	五矿稀土	5,700	65,094.00	0.14
174	601058	赛轮轮胎	18,440	65,093.20	0.14
175	300038	数知科技	7,960	64,953.60	0.14
176	600604	市北高新	6,900	64,929.00	0.14
177	600360	华微电子	7,500	64,800.00	0.14
178	600503	华丽家族	14,600	64,386.00	0.14
179	300068	南都电源	6,000	63,960.00	0.13
180	300149	量子生物	3,400	63,886.00	0.13
181	300633	开立医疗	1,600	63,440.00	0.13
182	603393	新天然气	1,720	63,382.00	0.13
183	600093	易见股份	5,400	63,288.00	0.13
184	000652	泰达股份	10,100	63,125.00	0.13
185	000810	创维数字	5,200	62,816.00	0.13
186	600789	鲁抗医药	6,840	62,722.80	0.13
187	000793	华闻集团	15,200	62,624.00	0.13
188	000936	华西股份	5,000	62,500.00	0.13
189	002698	博实股份	4,900	62,475.00	0.13
190	603713	密尔克卫	600	62,412.00	0.13
191	000516	国际医学	15,400	62,370.00	0.13

192	000875	吉电股份	16,700	62,124.00	0.13
193	600803	新奥股份	6,000	62,040.00	0.13
194	002798	帝欧家居	1,900	61,693.00	0.13
195	002324	普利特	4,100	61,541.00	0.13
196	600986	科达股份	12,740	61,534.20	0.13
197	002959	小熊电器	500	61,500.00	0.13
198	600850	华东电脑	2,500	61,275.00	0.13
199	000688	国城矿业	3,300	61,149.00	0.13
200	601375	中原证券	13,000	61,100.00	0.13
201	300327	中颖电子	1,880	60,912.00	0.13
202	300523	辰安科技	1,300	60,892.00	0.13
203	002171	楚江新材	6,500	60,710.00	0.13
204	600864	哈投股份	10,100	60,701.00	0.13
205	000006	深振业 A	8,900	60,609.00	0.13
206	002498	汉缆股份	13,000	60,580.00	0.13
207	002261	拓维信息	7,400	60,384.00	0.13
208	300339	润和软件	5,800	60,146.00	0.13
209	002020	京新药业	5,600	59,864.00	0.13
210	000789	万年青	4,650	59,845.50	0.13
211	002626	金达威	2,300	59,708.00	0.13
212	300751	迈为股份	200	59,392.00	0.12
213	300053	欧比特	5,445	59,132.70	0.12
214	000049	德赛电池	1,200	58,812.00	0.12
215	000429	粤高速 A	8,400	58,716.00	0.12
216	002421	达实智能	15,100	58,588.00	0.12
217	300497	富祥药业	2,988	58,475.16	0.12
218	002428	云南锗业	5,100	58,140.00	0.12
219	000915	山大华特	1,770	57,967.50	0.12
220	600612	老凤祥	1,200	57,828.00	0.12
221	002301	齐心集团	3,500	57,470.00	0.12
222	600456	宝钛股份	2,100	57,435.00	0.12
223	600756	浪潮软件	3,100	57,350.00	0.12
224	600057	厦门象屿	10,426	57,134.48	0.12
225	002239	奥特佳	14,000	57,120.00	0.12
226	603368	柳药股份	2,470	56,686.50	0.12
227	300123	亚光科技	4,940	56,661.80	0.12
228	002292	奥飞娱乐	6,700	56,414.00	0.12
229	002859	洁美科技	1,880	56,362.40	0.12
230	603718	海利生物	3,085	56,332.10	0.12
231	002449	国星光电	4,830	56,028.00	0.12
232	600868	梅雁吉祥	18,500	55,870.00	0.12
233	002254	泰和新材	4,100	55,760.00	0.12

234	601222	林洋能源	10,208	55,735.68	0.12
235	000902	新洋丰	6,300	55,692.00	0.12
236	600320	振华重工	19,380	55,620.60	0.12
237	002850	科达利	800	55,360.00	0.12
238	603606	东方电缆	3,800	55,252.00	0.12
239	300406	九强生物	2,400	55,200.00	0.12
240	002042	华孚时尚	8,850	55,135.50	0.12
241	300322	硕贝德	3,200	54,848.00	0.12
242	002091	江苏国泰	9,060	54,813.00	0.12
243	300568	星源材质	2,942	54,780.04	0.11
244	300735	光弘科技	2,966	54,722.70	0.11
245	600110	诺德股份	11,200	54,656.00	0.11
246	603613	国联股份	580	54,520.00	0.11
247	600490	鹏欣资源	17,300	54,495.00	0.11
248	300085	银之杰	3,400	54,468.00	0.11
249	000070	特发信息	5,580	54,237.60	0.11
250	603323	苏农银行	12,210	54,212.40	0.11
251	600685	中船防务	3,200	54,112.00	0.11
252	603236	移远通信	260	54,080.00	0.11
253	300045	华力创通	4,200	53,886.00	0.11
254	002194	武汉凡谷	2,600	53,820.00	0.11
255	603601	XD 再升科	4,100	53,710.00	0.11
256	603588	高能环境	4,600	53,636.00	0.11
257	603118	共进股份	4,500	53,505.00	0.11
258	000921	海信家电	4,400	53,504.00	0.11
259	600337	美克家居	12,100	53,482.00	0.11
260	300319	麦捷科技	4,800	53,328.00	0.11
261	603308	应流股份	2,600	53,040.00	0.11
262	603018	中设集团	5,440	52,931.20	0.11
263	600363	联创光电	3,400	52,666.00	0.11
264	300663	科蓝软件	1,900	52,649.00	0.11
265	002430	杭氧股份	3,700	52,540.00	0.11
266	600562	国睿科技	3,532	52,344.24	0.11
267	603043	广州酒家	1,600	52,032.00	0.11
268	600771	广誉远	3,700	51,911.00	0.11
269	002531	天顺风能	8,680	51,906.40	0.11
270	300429	强力新材	2,903	51,905.64	0.11
271	000976	华铁股份	9,300	51,894.00	0.11
272	300623	捷捷微电	1,720	51,686.00	0.11
273	601137	博威合金	3,300	51,612.00	0.11
274	300303	聚飞光电	8,740	51,478.60	0.11
275	000823	超声电子	3,700	51,467.00	0.11

276	002222	福晶科技	3,350	51,389.00	0.11
277	300020	银江股份	4,500	51,300.00	0.11
278	300607	拓斯达	1,260	51,269.40	0.11
279	600055	万东医疗	3,200	51,232.00	0.11
280	600378	昊华科技	2,500	51,225.00	0.11
281	300292	吴通控股	9,900	51,183.00	0.11
282	300398	飞凯材料	2,420	51,110.40	0.11
283	000901	航天科技	4,984	50,786.96	0.11
284	600422	昆药集团	5,200	50,752.00	0.11
285	000931	中关村	5,000	50,700.00	0.11
286	002276	万马股份	7,100	50,694.00	0.11
287	600210	紫江企业	11,800	50,622.00	0.11
288	000650	仁和药业	8,400	50,400.00	0.11
289	002446	盛路通信	7,020	50,193.00	0.11
290	300203	聚光科技	3,000	50,190.00	0.11
291	300748	金力永磁	1,500	50,070.00	0.11
292	603258	电魂网络	900	50,004.00	0.10
293	300185	通裕重工	25,500	49,980.00	0.10
294	600587	新华医疗	3,200	49,792.00	0.10
295	000683	远兴能源	26,740	49,736.40	0.10
296	000910	大亚圣象	3,200	49,728.00	0.10
297	002055	得润电子	3,300	49,698.00	0.10
298	002950	奥美医疗	1,750	49,665.00	0.10
299	600129	太极集团	3,500	49,490.00	0.10
300	600662	强生控股	6,200	49,476.00	0.10
301	300263	隆华科技	6,200	49,414.00	0.10
302	000546	金圆股份	4,900	49,343.00	0.10
303	300638	广和通	820	49,282.00	0.10
304	002777	久远银海	1,620	49,264.20	0.10
305	300815	玉禾田	400	49,056.00	0.10
306	002145	中核钛白	10,800	48,816.00	0.10
307	300284	苏交科	6,552	48,746.88	0.10
308	002312	三泰控股	10,700	48,685.00	0.10
309	002291	星期六	2,100	48,510.00	0.10
310	300143	盈康生命	2,900	48,372.00	0.10
311	002649	博彦科技	5,200	48,360.00	0.10
312	300602	飞荣达	1,469	48,212.58	0.10
313	600761	安徽合力	5,000	48,200.00	0.10
314	600420	现代制药	5,000	48,150.00	0.10
315	600668	尖峰集团	3,300	48,114.00	0.10
316	600108	亚盛集团	15,200	48,032.00	0.10
317	600116	三峡水利	5,400	48,006.00	0.10

318	002695	煌上煌	1,900	47,918.00	0.10
319	603583	捷昌驱动	700	47,866.00	0.10
320	002747	埃斯顿	4,000	47,840.00	0.10
321	600326	西藏天路	6,700	47,704.00	0.10
322	300377	赢时胜	5,100	47,634.00	0.10
323	600596	新安股份	5,500	47,300.00	0.10
324	600496	精工钢构	14,100	47,235.00	0.10
325	600072	中船科技	4,300	47,214.00	0.10
326	002115	三维通信	4,900	47,040.00	0.10
327	002547	春兴精工	6,600	46,992.00	0.10
328	002918	蒙娜丽莎	1,570	46,958.70	0.10
329	002459	晶澳科技	2,500	46,950.00	0.10
330	002320	海峡股份	4,267	46,937.00	0.10
331	002168	惠程科技	5,700	46,797.00	0.10
332	600284	浦东建设	7,600	46,740.00	0.10
333	603387	基蛋生物	1,160	46,736.40	0.10
334	002104	恒宝股份	5,476	46,600.76	0.10
335	601567	三星医疗	6,800	46,580.00	0.10
336	300232	洲明科技	5,748	46,501.32	0.10
337	300287	飞利信	11,200	46,480.00	0.10
338	002610	爱康科技	34,900	46,417.00	0.10
339	002258	利尔化学	2,600	46,358.00	0.10
340	002240	威华股份	3,600	46,332.00	0.10
341	300672	国科微	900	46,269.00	0.10
342	600624	复旦复华	4,630	46,253.70	0.10
343	300761	立华股份	1,200	46,248.00	0.10
344	000969	安泰科技	7,000	46,200.00	0.10
345	002567	唐人神	4,850	46,172.00	0.10
346	300664	鹏鹞环保	5,000	46,150.00	0.10
347	002545	东方铁塔	6,000	46,080.00	0.10
348	000933	神火股份	11,100	46,065.00	0.10
349	002376	新北洋	4,500	45,855.00	0.10
350	600750	江中药业	3,620	45,756.80	0.10
351	600602	云赛智联	6,300	45,738.00	0.10
352	600477	杭萧钢构	12,570	45,629.10	0.10
353	603599	广信股份	2,700	45,549.00	0.10
354	002530	金财互联	3,720	45,532.80	0.10
355	600200	江苏吴中	6,900	45,333.00	0.10
356	600499	科达洁能	11,000	45,320.00	0.10
357	300177	中海达	4,650	45,244.50	0.09
358	002043	兔宝宝	5,300	45,209.00	0.09
359	603429	集友股份	1,420	45,198.60	0.09

360	002139	拓邦股份	8,025	45,180.75	0.09
361	600226	*ST 瀚叶	19,206	45,134.10	0.09
362	002717	岭南股份	10,480	45,064.00	0.09
363	300075	数字政通	3,400	45,050.00	0.09
364	601010	文峰股份	14,400	44,784.00	0.09
365	002484	江海股份	4,816	44,644.32	0.09
366	601929	吉视传媒	20,800	44,512.00	0.09
367	000088	盐田港	7,500	44,400.00	0.09
368	600783	XD 鲁信创	2,900	44,370.00	0.09
369	300131	英唐智控	8,300	44,322.00	0.09
370	300741	华宝股份	1,200	44,256.00	0.09
371	002097	山河智能	7,400	44,178.00	0.09
372	002135	东南网架	6,000	44,100.00	0.09
373	000560	我爱我家	13,780	44,096.00	0.09
374	000030	富奥股份	6,900	44,091.00	0.09
375	000036	华联控股	10,010	44,044.00	0.09
376	002161	远望谷	5,500	44,000.00	0.09
377	002596	海南瑞泽	6,600	43,956.00	0.09
378	002298	中电兴发	5,400	43,902.00	0.09
379	603826	坤彩科技	1,300	43,641.00	0.09
380	000697	炼石航空	4,600	43,608.00	0.09
381	002733	雄韬股份	2,050	43,562.50	0.09
382	601588	北辰实业	15,500	43,555.00	0.09
383	300184	力源信息	6,840	43,502.40	0.09
384	300624	万兴科技	540	43,470.00	0.09
385	600114	东睦股份	4,180	43,388.40	0.09
386	002364	中恒电气	3,200	43,360.00	0.09
387	600851	海欣股份	5,800	43,326.00	0.09
388	300616	尚品宅配	720	43,257.60	0.09
389	001696	宗申动力	6,700	43,148.00	0.09
390	300194	福安药业	8,100	43,011.00	0.09
391	002041	登海种业	3,400	43,010.00	0.09
392	600059	古越龙山	4,600	42,872.00	0.09
393	002617	露笑科技	8,799	42,763.14	0.09
394	300034	钢研高纳	2,279	42,754.04	0.09
395	300438	鹏辉能源	2,450	42,752.50	0.09
396	002582	好想你	3,500	42,735.00	0.09
397	002585	双星新材	6,790	42,709.10	0.09
398	600063	皖维高新	13,100	42,706.00	0.09
399	000676	智度股份	5,000	42,700.00	0.09
400	002383	合众思壮	4,400	42,636.00	0.09
401	002768	国恩股份	1,300	42,601.00	0.09

402	600512	腾达建设	15,600	42,588.00	0.09
403	300552	万集科技	1,000	42,580.00	0.09
404	300679	电连技术	1,330	42,533.40	0.09
405	300119	瑞普生物	1,900	42,465.00	0.09
406	000989	九芝堂	4,205	42,386.40	0.09
407	600936	广西广电	11,000	42,350.00	0.09
408	603489	八方股份	300	42,297.00	0.09
409	601666	平煤股份	11,300	42,262.00	0.09
410	002489	浙江永强	10,600	42,188.00	0.09
411	002308	威创股份	6,200	42,098.00	0.09
412	000059	华锦股份	9,300	42,036.00	0.09
413	300101	振芯科技	3,800	41,990.00	0.09
414	603533	掌阅科技	1,100	41,943.00	0.09
415	600742	一汽富维	5,096	41,889.12	0.09
416	603108	润达医疗	3,140	41,824.80	0.09
417	300596	利安隆	1,200	41,796.00	0.09
418	600831	广电网络	5,400	41,688.00	0.09
419	002611	东方精工	9,040	41,674.40	0.09
420	600846	同济科技	4,900	41,650.00	0.09
421	300455	康拓红外	2,800	41,580.00	0.09
422	002515	金字火腿	6,620	41,573.60	0.09
423	600740	山西焦化	9,620	41,558.40	0.09
424	300256	星星科技	6,550	41,527.00	0.09
425	603989	艾华集团	1,430	41,498.60	0.09
426	002672	东江环保	4,600	41,446.00	0.09
427	002832	比音勒芬	2,420	41,430.40	0.09
428	601908	京运通	9,500	41,420.00	0.09
429	002197	证通电子	4,000	41,400.00	0.09
430	601011	宝泰隆	10,800	41,256.00	0.09
431	600391	航发科技	2,200	41,162.00	0.09
432	603222	济民制药	1,200	41,160.00	0.09
433	600285	羚锐制药	4,400	41,140.00	0.09
434	603636	南威软件	3,400	41,140.00	0.09
435	300248	新开普	3,323	41,072.28	0.09
436	601163	三角轮胎	3,100	41,044.00	0.09
437	002367	康力电梯	4,700	41,031.00	0.09
438	300055	万邦达	6,700	41,004.00	0.09
439	601369	陕鼓动力	6,500	40,885.00	0.09
440	600318	新力金融	3,200	40,768.00	0.09
441	002539	云图控股	5,900	40,710.00	0.09
442	002967	广电计量	1,500	40,650.00	0.09
443	002657	中科金财	2,600	40,378.00	0.08

444	002822	中装建设	4,700	40,232.00	0.08
445	603609	禾丰牧业	2,700	40,230.00	0.08
446	600510	黑牡丹	5,100	40,188.00	0.08
447	300229	拓尔思	3,500	40,180.00	0.08
448	300657	弘信电子	2,000	40,140.00	0.08
449	300401	花园生物	2,800	40,124.00	0.08
450	300662	科锐国际	900	40,050.00	0.08
451	002117	东港股份	3,550	40,044.00	0.08
452	000603	盛达资源	3,400	39,950.00	0.08
453	600611	大众交通	10,600	39,856.00	0.08
454	600269	赣粤高速	11,400	39,786.00	0.08
455	300145	中金环境	12,740	39,748.80	0.08
456	300328	宜安科技	3,320	39,740.40	0.08
457	300267	尔康制药	10,000	39,700.00	0.08
458	000796	凯撒旅业	3,800	39,672.00	0.08
459	603920	世运电路	1,600	39,664.00	0.08
460	002869	金溢科技	600	39,648.00	0.08
461	002609	捷顺科技	3,100	39,525.00	0.08
462	300016	北陆药业	3,250	39,520.00	0.08
463	002047	宝鹰股份	7,800	39,468.00	0.08
464	000900	现代投资	10,300	39,449.00	0.08
465	002512	达华智能	7,800	39,390.00	0.08
466	300219	鸿利智汇	4,150	39,383.50	0.08
467	000926	福星股份	7,500	39,375.00	0.08
468	002130	沃尔核材	8,600	39,302.00	0.08
469	300299	富春股份	4,340	39,277.00	0.08
470	300353	东土科技	3,500	39,270.00	0.08
471	603113	金能科技	3,300	39,237.00	0.08
472	603218	日月股份	2,140	39,162.00	0.08
473	002182	云海金属	4,100	39,114.00	0.08
474	300590	移为通信	1,200	39,072.00	0.08
475	002313	日海智能	2,100	39,060.00	0.08
476	300130	新国都	2,840	39,050.00	0.08
477	600552	凯盛科技	6,000	39,000.00	0.08
478	000836	富通鑫茂	11,800	38,940.00	0.08
479	000592	平潭发展	15,000	38,850.00	0.08
480	300171	东富龙	2,400	38,832.00	0.08
481	000682	东方电子	7,800	38,688.00	0.08
482	002668	奥马电器	8,494	38,647.70	0.08
483	000829	天音控股	5,900	38,645.00	0.08
484	002341	新纶科技	7,900	38,631.00	0.08
485	300310	宜通世纪	6,888	38,572.80	0.08

486	300448	浩云科技	4,000	38,200.00	0.08
487	600366	宁波韵升	6,700	38,190.00	0.08
488	002083	孚日股份	7,100	38,056.00	0.08
489	600502	XD 安徽建	9,856	38,044.16	0.08
490	300007	汉威科技	2,300	38,019.00	0.08
491	002277	友阿股份	9,500	38,000.00	0.08
492	300495	美尚生态	3,983	37,918.16	0.08
493	601952	苏垦农发	3,990	37,825.20	0.08
494	002234	民和股份	1,700	37,706.00	0.08
495	000720	新能泰山	7,500	37,650.00	0.08
496	300349	金卡智能	2,500	37,625.00	0.08
497	600197	伊力特	1,900	37,563.00	0.08
498	300158	振东制药	7,000	37,450.00	0.08
499	002283	天润工业	8,600	37,410.00	0.08
500	300238	冠昊生物	2,100	37,401.00	0.08
501	603026	石大胜华	1,400	37,366.00	0.08
502	603690	至纯科技	900	37,242.00	0.08
503	002550	千红制药	8,600	37,152.00	0.08
504	300604	长川科技	1,200	36,948.00	0.08
505	300755	华致酒行	1,140	36,936.00	0.08
506	600636	国新文化	3,000	36,900.00	0.08
507	603666	亿嘉和	420	36,859.20	0.08
508	600308	华泰股份	8,000	36,800.00	0.08
509	002565	顺灏股份	7,200	36,576.00	0.08
510	002639	雪人股份	5,300	36,570.00	0.08
511	000795	英洛华	6,400	36,544.00	0.08
512	002235	安妮股份	4,475	36,471.25	0.08
513	601677	明泰铝业	4,200	36,456.00	0.08
514	600577	精达股份	13,100	36,418.00	0.08
515	002488	金固股份	6,850	36,305.00	0.08
516	002618	丹邦科技	3,750	36,187.50	0.08
517	300183	东软载波	2,300	36,087.00	0.08
518	300209	天泽信息	2,100	36,036.00	0.08
519	300137	先河环保	5,400	36,018.00	0.08
520	600239	云南城投	9,400	36,002.00	0.08
521	601918	新集能源	15,100	35,938.00	0.08
522	603111	康尼机电	5,800	35,902.00	0.08
523	600480	凌云股份	3,200	35,840.00	0.08
524	002318	久立特材	4,900	35,770.00	0.08
525	002479	富春环保	6,100	35,746.00	0.08
526	600990	四创电子	900	35,730.00	0.07
527	600105	XD 永鼎股	8,440	35,616.80	0.07

528	000155	川能动力	7,200	35,496.00	0.07
529	603298	杭叉集团	3,220	35,484.40	0.07
530	600764	中国海防	1,400	35,420.00	0.07
531	002073	软控股份	9,100	35,399.00	0.07
532	002928	华夏航空	2,350	35,367.50	0.07
533	002226	江南化工	6,100	35,197.00	0.07
534	002522	浙江众成	5,300	35,192.00	0.07
535	300047	天源迪科	4,845	35,174.70	0.07
536	601890	亚星锚链	6,500	35,165.00	0.07
537	603363	傲农生物	1,500	35,055.00	0.07
538	600975	新五丰	3,800	35,036.00	0.07
539	002838	道恩股份	1,200	35,028.00	0.07
540	002034	旺能环境	2,000	34,880.00	0.07
541	000973	佛塑科技	7,500	34,800.00	0.07
542	300266	兴源环境	10,600	34,768.00	0.07
543	002537	海联金汇	5,980	34,743.80	0.07
544	300190	维尔利	4,600	34,730.00	0.07
545	300684	中石科技	1,000	34,700.00	0.07
546	002556	辉隆股份	4,200	34,692.00	0.07
547	002279	久其软件	4,780	34,655.00	0.07
548	601069	西部黄金	2,500	34,575.00	0.07
549	600736	苏州高新	6,700	34,572.00	0.07
550	000801	四川九洲	5,900	34,456.00	0.07
551	603305	旭升股份	900	34,452.00	0.07
552	002573	清新环境	6,300	34,398.00	0.07
553	600103	青山纸业	17,970	34,322.70	0.07
554	600550	保变电气	7,100	34,293.00	0.07
555	600622	光大嘉宝	8,720	34,269.60	0.07
556	300386	飞天诚信	2,000	34,240.00	0.07
557	300222	科大智能	4,220	34,224.20	0.07
558	002474	榕基软件	4,800	34,224.00	0.07
559	600449	宁夏建材	2,800	34,216.00	0.07
560	300477	合纵科技	4,860	34,214.40	0.07
561	002970	锐明技术	500	34,165.00	0.07
562	603887	城地股份	1,400	34,160.00	0.07
563	300044	赛为智能	5,080	34,086.80	0.07
564	300441	鲍斯股份	3,160	34,033.20	0.07
565	002755	奥赛康	1,800	34,020.00	0.07
566	000597	东北制药	6,500	33,930.00	0.07
567	300803	指南针	600	33,858.00	0.07
568	603128	华贸物流	5,800	33,698.00	0.07
569	000913	钱江摩托	2,500	33,675.00	0.07

570	300355	蒙草生态	12,500	33,625.00	0.07
571	002108	沧州明珠	9,642	33,457.74	0.07
572	600169	太原重工	17,500	33,425.00	0.07
573	600300	维维股份	11,400	33,402.00	0.07
574	600855	航天长峰	2,100	33,390.00	0.07
575	300726	宏达电子	1,200	33,372.00	0.07
576	000726	鲁泰A	4,400	33,352.00	0.07
577	300224	正海磁材	3,850	33,341.00	0.07
578	002880	卫光生物	500	33,340.00	0.07
579	600531	豫光金铅	8,500	33,320.00	0.07
580	300531	优博讯	1,600	33,280.00	0.07
581	000601	韶能股份	6,300	33,201.00	0.07
582	600400	红豆股份	9,820	33,191.60	0.07
583	601965	中国汽研	3,800	33,136.00	0.07
584	002726	龙大肉食	3,924	33,118.56	0.07
585	000507	珠海港	6,300	33,012.00	0.07
586	000918	嘉凯城	7,000	32,900.00	0.07
587	300559	佳发教育	1,550	32,891.00	0.07
588	300487	蓝晓科技	1,000	32,880.00	0.07
589	300039	上海凯宝	6,100	32,879.00	0.07
590	002067	景兴纸业	10,800	32,832.00	0.07
591	600676	交运股份	5,900	32,804.00	0.07
592	600217	中再资环	6,800	32,776.00	0.07
593	300366	创意信息	3,600	32,760.00	0.07
594	600483	福能股份	4,500	32,670.00	0.07
595	300311	任子行	4,631	32,648.55	0.07
596	002303	美盈森	7,500	32,625.00	0.07
597	300114	中航电测	2,850	32,518.50	0.07
598	300603	立昂技术	1,100	32,263.00	0.07
599	002204	大连重工	7,500	32,250.00	0.07
600	603068	博通集成	400	32,232.00	0.07
601	002737	葵花药业	2,200	32,186.00	0.07
602	002322	理工环科	2,700	32,184.00	0.07
603	000011	深物业A	2,000	32,000.00	0.07
604	002947	恒铭达	500	32,000.00	0.07
605	002031	巨轮智能	17,100	31,977.00	0.07
606	600775	南京熊猫	3,900	31,941.00	0.07
607	603185	上机数控	650	31,843.50	0.07
608	600495	晋西车轴	8,280	31,795.20	0.07
609	601001	大同煤业	8,100	31,752.00	0.07
610	300613	富瀚微	280	31,724.00	0.07
611	600825	新华传媒	5,100	31,671.00	0.07

612	603060	国检集团	1,580	31,584.20	0.07
613	600123	兰花科创	6,700	31,557.00	0.07
614	600523	贵航股份	1,860	31,545.60	0.07
615	603660	苏州科达	3,440	31,544.80	0.07
616	002215	诺普信	5,300	31,482.00	0.07
617	002358	森源电气	6,300	31,437.00	0.07
618	600075	新疆天业	6,480	31,428.00	0.07
619	600963	岳阳林纸	8,830	31,346.50	0.07
620	002462	嘉事堂	2,300	31,326.00	0.07
621	300773	拉卡拉	900	31,293.00	0.07
622	300198	纳川股份	8,080	31,269.60	0.07
623	300527	中船应急	3,443	31,228.01	0.07
624	603383	顶点软件	700	31,213.00	0.07
625	002461	珠江啤酒	3,100	31,062.00	0.07
626	300102	乾照光电	6,900	31,050.00	0.07
627	002307	北新路桥	5,200	30,992.00	0.07
628	002017	东信和平	2,600	30,992.00	0.07
629	603688	石英股份	1,300	30,966.00	0.06
630	600571	信雅达	3,400	30,906.00	0.06
631	600020	中原高速	8,700	30,798.00	0.06
632	002792	通宇通讯	1,250	30,725.00	0.06
633	300081	恒信东方	3,600	30,672.00	0.06
634	002510	天汽模	7,200	30,672.00	0.06
635	603012	创力集团	4,300	30,659.00	0.06
636	002343	慈文传媒	3,530	30,640.40	0.06
637	601366	利群股份	5,000	30,550.00	0.06
638	600133	东湖高新	5,400	30,510.00	0.06
639	300388	国祯环保	3,300	30,426.00	0.06
640	300783	三只松鼠	400	30,392.00	0.06
641	603267	鸿远电子	700	30,275.00	0.06
642	300336	新文化	6,150	30,258.00	0.06
643	600708	光明地产	10,767	30,255.27	0.06
644	000882	华联股份	16,000	30,240.00	0.06
645	002166	莱茵生物	3,800	30,134.00	0.06
646	300393	中来股份	4,505	30,093.40	0.06
647	000802	北京文化	4,900	30,037.00	0.06
648	300066	三川智慧	6,100	30,012.00	0.06
649	300065	海兰信	3,050	30,012.00	0.06
650	601116	三江购物	2,100	30,009.00	0.06
651	000957	中通客车	4,600	29,946.00	0.06
652	300368	汇金股份	3,100	29,915.00	0.06
653	603313	梦百合	1,270	29,883.10	0.06

654	300409	道氏技术	2,660	29,845.20	0.06
655	300191	潜能恒信	1,600	29,824.00	0.06
656	600261	阳光照明	8,400	29,820.00	0.06
657	300332	天壕环境	6,800	29,716.00	0.06
658	000040	东旭蓝天	10,100	29,694.00	0.06
659	300423	鲁亿通	2,400	29,664.00	0.06
660	002224	三力士	4,900	29,596.00	0.06
661	000557	西部创业	8,500	29,495.00	0.06
662	300091	金通灵	8,320	29,369.60	0.06
663	002314	南山控股	7,800	29,328.00	0.06
664	002746	仙坛股份	2,210	29,282.50	0.06
665	000639	西王食品	5,224	29,202.16	0.06
666	603803	瑞斯康达	2,500	29,200.00	0.06
667	000797	中国武夷	7,641	29,188.62	0.06
668	603367	辰欣药业	1,800	29,106.00	0.06
669	000968	蓝焰控股	3,800	29,070.00	0.06
670	600626	申达股份	5,800	29,058.00	0.06
671	601126	四方股份	4,800	29,040.00	0.06
672	000996	中国中期	3,350	28,944.00	0.06
673	601700	风范股份	5,500	28,930.00	0.06
674	300323	华灿光电	5,300	28,885.00	0.06
675	600681	百川能源	5,620	28,774.40	0.06
676	600894	广日股份	4,200	28,770.00	0.06
677	600343	航天动力	3,700	28,712.00	0.06
678	600759	洲际油气	15,400	28,644.00	0.06
679	600997	开滦股份	6,200	28,520.00	0.06
680	600773	西藏城投	4,800	28,512.00	0.06
681	300579	数字认证	700	28,511.00	0.06
682	600331	宏达股份	13,800	28,428.00	0.06
683	000751	锌业股份	11,000	28,380.00	0.06
684	601606	长城军工	2,100	28,308.00	0.06
685	000958	东方能源	6,800	28,288.00	0.06
686	000935	四川双马	2,200	28,248.00	0.06
687	002518	科士达	2,275	28,210.00	0.06
688	600987	航民股份	5,270	28,194.50	0.06
689	603979	金诚信	2,734	28,187.54	0.06
690	002309	中利集团	5,100	28,050.00	0.06
691	603220	中贝通信	1,600	28,000.00	0.06
692	300043	星辉娱乐	7,000	28,000.00	0.06
693	002061	浙江交科	5,400	27,972.00	0.06
694	002206	海利得	8,300	27,971.00	0.06
695	300110	华仁药业	6,820	27,962.00	0.06

696	300096	易联众	3,300	27,951.00	0.06
697	603008	喜临门	2,600	27,898.00	0.06
698	603337	杰克股份	1,272	27,856.80	0.06
699	002663	普邦股份	12,200	27,816.00	0.06
700	603801	志邦家居	1,040	27,757.60	0.06
701	300571	平治信息	600	27,720.00	0.06
702	300300	汉鼎宇佑	4,575	27,678.75	0.06
703	300276	三丰智能	5,580	27,565.20	0.06
704	601330	绿色动力	2,900	27,550.00	0.06
705	002930	宏川智慧	1,958	27,549.06	0.06
706	002677	浙江美大	2,440	27,523.20	0.06
707	300740	御家汇	2,000	27,520.00	0.06
708	603399	吉翔股份	3,700	27,454.00	0.06
709	002519	银河电子	6,610	27,431.50	0.06
710	002614	奥佳华	2,500	27,425.00	0.06
711	002335	科华恒盛	1,300	27,417.00	0.06
712	600981	汇鸿集团	8,700	27,318.00	0.06
713	300504	天邑股份	1,000	27,300.00	0.06
714	601949	中国出版	5,200	27,300.00	0.06
715	600590	泰豪科技	5,060	27,273.40	0.06
716	002228	合兴包装	6,800	27,268.00	0.06
717	002443	金洲管道	4,000	27,240.00	0.06
718	000666	经纬纺机	3,000	27,180.00	0.06
719	603869	新智认知	2,500	27,175.00	0.06
720	601789	宁波建工	5,700	27,132.00	0.06
721	300302	同有科技	2,140	27,113.80	0.06
722	002833	弘亚数控	1,100	26,983.00	0.06
723	000925	众合科技	3,700	26,973.00	0.06
724	603458	勘设股份	1,295	26,936.00	0.06
725	300006	莱美药业	5,138	26,923.12	0.06
726	002158	汉钟精机	1,900	26,885.00	0.06
727	002274	华昌化工	5,600	26,712.00	0.06
728	300634	彩讯股份	1,200	26,676.00	0.06
729	000811	冰轮环境	4,250	26,605.00	0.06
730	600096	云天化	5,600	26,600.00	0.06
731	603595	东尼电子	824	26,532.80	0.06
732	600971	恒源煤电	5,800	26,506.00	0.06
733	603626	科森科技	2,180	26,487.00	0.06
734	600351	亚宝药业	5,200	26,468.00	0.06
735	002776	柏堡龙	3,100	26,412.00	0.06
736	002218	拓日新能	7,200	26,280.00	0.06
737	002267	陕天然气	4,300	26,273.00	0.06

738	300252	金信诺	2,740	26,221.80	0.06
739	300765	新诺威	1,160	26,146.40	0.05
740	600162	香江控股	13,250	26,102.50	0.05
741	603359	东珠生态	1,560	26,098.80	0.05
742	300570	太辰光	1,300	26,000.00	0.05
743	300205	天喻信息	2,500	26,000.00	0.05
744	002619	艾格拉斯	10,480	25,990.40	0.05
745	002344	海宁皮城	6,200	25,978.00	0.05
746	300255	常山药业	4,500	25,965.00	0.05
747	002245	澳洋顺昌	6,700	25,929.00	0.05
748	002243	通产丽星	1,800	25,920.00	0.05
749	002929	润建股份	900	25,911.00	0.05
750	002433	太安堂	5,900	25,842.00	0.05
751	002029	七匹狼	5,100	25,806.00	0.05
752	603730	岱美股份	800	25,800.00	0.05
753	300213	佳讯飞鸿	4,000	25,800.00	0.05
754	000019	深粮控股	3,200	25,728.00	0.05
755	002137	麦达数字	3,400	25,704.00	0.05
756	300204	舒泰神	2,300	25,668.00	0.05
757	600389	江山股份	1,400	25,606.00	0.05
758	600548	深高速	2,800	25,592.00	0.05
759	300762	上海瀚讯	800	25,520.00	0.05
760	002636	金安国纪	2,800	25,508.00	0.05
761	002796	世嘉科技	1,200	25,380.00	0.05
762	601886	江河集团	4,400	25,300.00	0.05
763	600458	时代新材	3,900	25,272.00	0.05
764	603360	百傲化学	1,300	25,259.00	0.05
765	600229	城市传媒	3,400	25,228.00	0.05
766	000950	重药控股	5,000	25,200.00	0.05
767	002482	广田集团	7,500	25,125.00	0.05
768	002664	长鹰信质	1,900	25,118.00	0.05
769	300785	值得买	199	25,016.29	0.05
770	603508	思维列控	740	24,893.60	0.05
771	002756	永兴材料	1,300	24,817.00	0.05
772	600995	文山电力	3,300	24,816.00	0.05
773	002167	东方锆业	4,800	24,816.00	0.05
774	000550	江铃汽车	2,000	24,740.00	0.05
775	000520	长航凤凰	6,800	24,684.00	0.05
776	600035	楚天高速	8,200	24,682.00	0.05
777	002840	华统股份	1,300	24,622.00	0.05
778	300365	恒华科技	2,400	24,480.00	0.05
779	000567	海德股份	1,900	24,434.00	0.05

780	002229	鸿博股份	3,350	24,421.50	0.05
781	000544	中原环保	3,750	24,412.50	0.05
782	600090	*ST 济堂	8,400	24,360.00	0.05
783	000665	湖北广电	4,640	24,267.20	0.05
784	002095	生意宝	1,200	24,240.00	0.05
785	603927	中科软	400	24,176.00	0.05
786	300061	旗天科技	4,000	24,120.00	0.05
787	600184	光电股份	2,500	24,100.00	0.05
788	300788	中信出版	500	24,095.00	0.05
789	000038	深大通	1,980	24,057.00	0.05
790	002542	中化岩土	7,050	23,970.00	0.05
791	600810	神马股份	3,360	23,956.80	0.05
792	000532	华金资本	2,000	23,880.00	0.05
793	601515	东风股份	3,900	23,829.00	0.05
794	300682	朗新科技	1,400	23,828.00	0.05
795	300378	鼎捷软件	1,750	23,800.00	0.05
796	002393	力生制药	900	23,733.00	0.05
797	002913	奥士康	400	23,712.00	0.05
798	603980	吉华集团	3,400	23,698.00	0.05
799	002060	粤水电	8,200	23,698.00	0.05
800	600933	爱柯迪	1,700	23,664.00	0.05
801	000928	中钢国际	6,020	23,658.60	0.05
802	603919	金徽酒	1,360	23,650.40	0.05
803	603612	索通发展	2,060	23,525.20	0.05
804	300533	冰川网络	650	23,517.00	0.05
805	601900	南方传媒	2,600	23,504.00	0.05
806	300439	美康生物	1,300	23,491.00	0.05
807	000889	中嘉博创	2,600	23,322.00	0.05
808	002564	天沃科技	5,900	23,305.00	0.05
809	603590	康辰药业	600	23,256.00	0.05
810	000584	哈工智能	4,200	23,226.00	0.05
811	600603	广汇物流	4,900	23,079.00	0.05
812	002685	华东重机	3,900	23,010.00	0.05
813	300208	青岛中程	3,650	22,922.00	0.05
814	603587	地素时尚	1,360	22,916.00	0.05
815	300215	电科院	3,700	22,866.00	0.05
816	600136	当代文体	2,800	22,848.00	0.05
817	300510	金冠股份	5,179	22,787.60	0.05
818	600569	安阳钢铁	11,200	22,736.00	0.05
819	002478	常宝股份	4,700	22,701.00	0.05
820	002355	兴民智通	4,200	22,680.00	0.05
821	600076	康欣新材	7,000	22,540.00	0.05

822	000615	京汉股份	5,300	22,525.00	0.05
823	300140	中环装备	2,500	22,450.00	0.05
824	600322	天房发展	8,600	22,446.00	0.05
825	600800	天津磁卡	4,800	22,416.00	0.05
826	002562	兄弟科技	4,260	22,365.00	0.05
827	000815	美利云	3,300	22,275.00	0.05
828	600581	八一钢铁	7,300	22,265.00	0.05
829	000525	红太阳	2,800	22,232.00	0.05
830	600929	湖南盐业	3,600	22,212.00	0.05
831	300148	天舟文化	5,600	22,176.00	0.05
832	002516	旷达科技	7,200	22,176.00	0.05
833	600710	苏美达	5,100	22,134.00	0.05
834	300288	朗玛信息	1,900	22,097.00	0.05
835	600691	阳煤化工	11,500	22,080.00	0.05
836	000058	深赛格	2,800	22,008.00	0.05
837	000620	新华联	6,900	21,873.00	0.05
838	603777	来伊份	1,300	21,866.00	0.05
839	603357	设计总院	2,200	21,780.00	0.05
840	603959	百利科技	2,456	21,612.80	0.05
841	600533	栖霞建设	5,900	21,594.00	0.05
842	300723	一品红	500	21,545.00	0.05
843	600897	厦门空港	1,200	21,492.00	0.05
844	603466	风语筑	1,100	21,417.00	0.04
845	000065	北方国际	2,925	21,381.75	0.04
846	601107	四川成渝	6,300	21,357.00	0.04
847	600467	好当家	8,500	21,335.00	0.04
848	300237	美晨生态	9,900	21,285.00	0.04
849	300793	佳禾智能	800	21,280.00	0.04
850	002741	光华科技	1,800	21,240.00	0.04
851	601595	上海电影	1,400	21,112.00	0.04
852	603105	芯能科技	2,400	21,096.00	0.04
853	002015	协鑫能科	4,000	21,040.00	0.04
854	002284	亚太股份	4,300	20,984.00	0.04
855	603421	鼎信通讯	1,400	20,972.00	0.04
856	603728	鸣志电器	1,600	20,864.00	0.04
857	000498	山东路桥	4,300	20,855.00	0.04
858	600965	福成股份	3,200	20,832.00	0.04
859	601858	中国科传	2,300	20,677.00	0.04
860	002955	鸿合科技	680	20,672.00	0.04
861	300021	大禹节水	4,700	20,633.00	0.04
862	000561	烽火电子	2,900	20,619.00	0.04
863	002751	易尚展示	900	20,448.00	0.04

864	600798	宁波海运	7,000	20,440.00	0.04
865	002305	南国置业	7,500	20,400.00	0.04
866	600054	黄山旅游	2,500	20,325.00	0.04
867	300424	航新科技	1,516	20,284.08	0.04
868	601020	华钰矿业	2,600	20,280.00	0.04
869	002246	北化股份	2,700	20,196.00	0.04
870	000657	中钨高新	3,380	20,144.80	0.04
871	002712	思美传媒	2,860	19,991.40	0.04
872	600230	沧州大化	2,360	19,942.00	0.04
873	002538	司尔特	4,100	19,721.00	0.04
874	002232	启明信息	2,000	19,620.00	0.04
875	000881	中广核技	2,700	19,602.00	0.04
876	603727	博迈科	1,100	19,525.00	0.04
877	300673	佩蒂股份	500	19,440.00	0.04
878	002662	京威股份	5,800	19,372.00	0.04
879	300011	鼎汉技术	3,300	19,371.00	0.04
880	603610	麒盛科技	600	19,248.00	0.04
881	002631	德尔未来	2,500	19,200.00	0.04
882	002621	美吉姆	3,120	19,156.80	0.04
883	002464	众应互联	3,334	19,137.16	0.04
884	000885	城发环境	1,900	18,981.00	0.04
885	600715	文投控股	7,100	18,957.00	0.04
886	603579	荣泰健康	700	18,774.00	0.04
887	603618	杭电股份	3,400	18,700.00	0.04
888	002646	青青稞酒	1,700	18,581.00	0.04
889	600278	东方创业	2,000	18,540.00	0.04
890	300768	迪普科技	400	18,516.00	0.04
891	603299	苏盐井神	3,000	18,510.00	0.04
892	300520	科大国创	1,000	18,490.00	0.04
893	300776	帝尔激光	220	18,431.60	0.04
894	300309	吉艾科技	5,080	18,186.40	0.04
895	000576	广东甘化	2,500	18,175.00	0.04
896	300771	智莱科技	480	18,144.00	0.04
897	000821	京山轻机	3,100	17,980.00	0.04
898	002101	广东鸿图	2,600	17,862.00	0.04
899	603063	禾望电气	2,500	17,800.00	0.04
900	603876	鼎胜新材	1,300	17,745.00	0.04
901	002435	长江健康	4,800	17,712.00	0.04
902	000822	山东海化	5,200	17,576.00	0.04
903	002933	新兴装备	500	17,545.00	0.04
904	000965	天保基建	5,380	17,485.00	0.04
905	000150	宜华健康	4,904	17,458.24	0.04

906	300799	左江科技	200	17,436.00	0.04
907	300109	新开源	1,174	17,386.94	0.04
908	601015	陕西黑猫	6,365	17,376.45	0.04
909	002345	潮宏基	5,200	17,316.00	0.04
910	603348	文灿股份	900	17,199.00	0.04
911	600242	*ST 中昌	2,700	17,145.00	0.04
912	603169	兰石重装	4,100	17,138.00	0.04
913	002962	五方光电	700	17,101.00	0.04
914	600758	辽宁能源	5,100	16,983.00	0.04
915	002141	贤丰控股	5,500	16,940.00	0.04
916	603896	寿仙谷	500	16,940.00	0.04
917	002852	道道全	1,150	16,583.00	0.03
918	300307	慈星股份	3,900	16,536.00	0.03
919	000923	河钢资源	1,300	16,380.00	0.03
920	300800	力合科技	500	16,330.00	0.03
921	002960	青鸟消防	700	16,324.00	0.03
922	600207	安彩高科	3,400	16,286.00	0.03
923	600876	洛阳玻璃	1,200	16,236.00	0.03
924	000791	甘肃电投	5,220	16,129.80	0.03
925	300506	名家汇	3,190	16,013.80	0.03
926	601101	昊华能源	4,400	15,972.00	0.03
927	300176	派生科技	2,990	15,906.80	0.03
928	000662	*ST 天夏	6,400	15,872.00	0.03
929	002782	可立克	1,200	15,852.00	0.03
930	603648	畅联股份	1,800	15,840.00	0.03
931	600686	金龙汽车	2,800	15,792.00	0.03
932	002016	世荣兆业	2,400	15,696.00	0.03
933	002590	万安科技	2,300	15,663.00	0.03
934	600618	氯碱化工	2,200	15,620.00	0.03
935	600738	兰州民百	3,000	15,510.00	0.03
936	000905	厦门港务	2,400	15,480.00	0.03
937	603808	歌力思	1,200	15,456.00	0.03
938	300262	巴安水务	3,900	15,405.00	0.03
939	600310	桂东电力	4,000	15,360.00	0.03
940	000517	荣安地产	6,200	15,190.00	0.03
941	603093	南华期货	700	15,078.00	0.03
942	603711	香飘飘	500	15,055.00	0.03
943	603839	安正时尚	1,180	14,986.00	0.03
944	603693	江苏新能	1,200	14,952.00	0.03
945	002451	摩恩电气	2,100	14,889.00	0.03
946	603619	中曼石油	1,200	14,868.00	0.03
947	300107	建新股份	2,700	14,796.00	0.03

948	002370	亚太药业	3,100	14,756.00	0.03
949	002378	章源钨业	3,600	14,544.00	0.03
950	002651	利君股份	3,000	14,520.00	0.03
951	001896	豫能控股	4,500	14,490.00	0.03
952	300777	中简科技	400	14,480.00	0.03
953	603318	派思股份	1,900	14,440.00	0.03
954	603053	成都燃气	1,000	14,290.00	0.03
955	300127	银河磁体	900	14,265.00	0.03
956	000056	皇庭国际	3,600	14,256.00	0.03
957	002638	*ST 勤上	6,650	13,965.00	0.03
958	002906	华阳集团	900	13,941.00	0.03
959	603915	国茂股份	900	13,833.00	0.03
960	002961	瑞达期货	500	13,825.00	0.03
961	002377	国创高新	3,500	13,685.00	0.03
962	002895	川恒股份	1,100	13,464.00	0.03
963	600295	鄂尔多斯	1,900	13,395.00	0.03
964	600283	钱江水利	1,300	13,377.00	0.03
965	603180	金牌厨柜	280	13,210.40	0.03
966	603390	通达电气	1,000	13,080.00	0.03
967	603327	福蓉科技	500	12,915.00	0.03
968	000626	远大控股	2,100	12,789.00	0.03
969	002346	柘中股份	1,300	12,779.00	0.03
970	000711	京蓝科技	4,000	12,760.00	0.03
971	000514	渝开发	3,300	12,606.00	0.03
972	300428	四通新材	800	12,096.00	0.03
973	601619	嘉泽新能	4,000	11,680.00	0.02
974	603557	起步股份	1,300	11,531.00	0.02
975	603530	神马电力	400	11,324.00	0.02
976	603733	仙鹤股份	700	11,249.00	0.02
977	603603	博天环境	1,600	11,040.00	0.02
978	300775	三角防务	500	10,820.00	0.02
979	603103	横店影视	680	10,744.00	0.02
980	603815	交建股份	500	10,425.00	0.02
981	002759	天际股份	1,600	10,224.00	0.02
982	603997	继峰股份	1,450	9,961.50	0.02
983	603956	威派格	600	9,882.00	0.02
984	603013	亚普股份	600	9,672.00	0.02
985	002973	侨银环保	400	9,376.00	0.02
986	300805	电声股份	400	9,168.00	0.02
987	002911	佛燃能源	600	9,120.00	0.02
988	603081	大丰实业	800	9,032.00	0.02
989	002951	金时科技	500	8,900.00	0.02

990	002907	华森制药	500	8,755.00	0.02
991	603279	景津环保	400	8,196.00	0.02
992	002485	希努尔	1,600	7,936.00	0.02
993	002969	嘉美包装	1,000	7,630.00	0.02
994	603687	大胜达	500	6,885.00	0.01
995	603848	好太太	500	6,825.00	0.01
996	603551	奥普家居	400	6,492.00	0.01
997	603676	卫信康	600	6,486.00	0.01
998	603992	松霖科技	400	6,384.00	0.01
999	300798	锦鸡股份	400	5,500.00	0.01

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

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	000029	深深房 A	6,200	67,022.00	0.14
2	002650	ST 加加	6,400	31,360.00	0.07
3	605166	聚合顺	1,158	18,354.30	0.04
4	300842	帝科股份	394	16,043.68	0.03
5	603087	甘李药业	150	15,045.00	0.03
6	300839	博汇股份	435	10,183.35	0.02
7	600069	退市银鸽	8,300	7,636.00	0.02
8	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.02
9	600175	退市美都	21,600	7,128.00	0.01
10	600956	新天绿能	1,408	7,096.32	0.01
11	300845	捷安高科	392	6,910.96	0.01
12	600734	*ST 实达	3,100	6,820.00	0.01
13	300840	酷特智能	841	4,995.54	0.01
14	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01
15	300180	华峰超纤	68	582.08	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002065	东华软件	212,276.00	0.45
2	603005	晶方科技	137,748.80	0.29
3	600882	妙可蓝多	117,966.00	0.25
4	300346	南大光电	111,924.00	0.24
5	300598	诚迈科技	111,600.00	0.24
6	603520	司太立	111,568.00	0.24
7	000652	泰达股份	108,150.00	0.23
8	002791	坚朗五金	106,860.00	0.23

9	300526	中潜股份	98,084.00	0.21
10	000403	双林生物	86,821.00	0.18
11	600873	梅花生物	85,243.00	0.18
12	300674	宇信科技	82,503.00	0.18
13	002706	良信电器	81,054.00	0.17
14	002214	大立科技	80,856.00	0.17
15	600267	海正药业	79,264.00	0.17
16	000503	国新健康	78,050.00	0.17
17	002310	东方园林	76,481.00	0.16
18	300659	中孚信息	75,382.00	0.16
19	300573	兴齐眼药	72,400.00	0.15
20	300792	壹网壹创	71,040.00	0.15

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300347	泰格医药	496,293.50	1.05
2	300014	亿纬锂能	330,299.07	0.70
3	002185	华天科技	309,581.40	0.66
4	002405	四维图新	261,578.00	0.55
5	300450	先导智能	260,888.00	0.55
6	300012	华测检测	253,176.00	0.54
7	300558	贝达药业	237,817.00	0.50
8	300357	我武生物	209,821.60	0.45
9	600529	山东药玻	205,753.00	0.44
10	300212	易华录	197,144.00	0.42
11	600918	中泰证券	193,564.04	0.41
12	300782	卓胜微	185,889.00	0.39
13	300271	华宇软件	184,306.60	0.39
14	300285	国瓷材料	181,149.00	0.38
15	300628	亿联网络	179,994.00	0.38
16	300496	中科创达	172,171.50	0.37
17	002138	顺络电子	163,817.00	0.35
18	300482	万孚生物	161,153.00	0.34
19	601799	星宇股份	152,520.00	0.32
20	002557	洽洽食品	150,158.00	0.32

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,934,729.80
卖出股票收入（成交）总额	16,893,263.90

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

无

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	1,626.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	624.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,251.60

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000029	深深房 A	67,022.00	0.14	重大事项停牌

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1000A	42	37,193.69	1,417,560.00	90.75	144,575.00	9.25
1000B	246	6,350.14	145.00	0.01	1,561,990.00	99.99
华宝中证 1000 指数分级	3,363	14,053.59	513,905.87	1.09	46,748,314.80	98.91
合计	3,651	13,800.74	1,931,610.87	3.83	48,454,879.80	96.17

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。

8.2 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	90.75
2	黄晖	33,399.00	2.14
3	曹蜀湘	31,200.00	2.00
4	唐梦雪	29,000.00	1.86
5	郭国棠	12,851.00	0.82

6	孙大威	6,663.00	0.43
7	邵文杰	5,911.00	0.38
8	陆成宝	4,533.00	0.29
9	何聪兰	4,080.00	0.26
10	张淑贤	2,742.00	0.18

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	21.82
2	祝东华	106,463.00	6.82
3	杨玉锋	84,314.00	5.40
4	解俊荣	62,129.00	3.98
5	石彩雯	57,712.00	3.69
6	曹国安	56,400.00	3.61
7	叶碧光	46,251.00	2.96
8	谢锦星	44,622.00	2.86
9	马新群	42,300.00	2.71
10	刘文卿	35,311.00	2.26

华宝中证 1000 指数分级

8.3 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	4,398.97	0.0093
	合计	4,398.97	0.0087

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	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

§ 9 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	1,734,179.00	1,734,179.00	53,897,880.99
本报告期基金总申购份额	-	-	2,141,993.24
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	9,121,741.56
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-172,044.00	-172,044.00	344,088.00
本报告期末基金份额总额	1,562,135.00	1,562,135.00	47,262,220.67

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2020 年 5 月 20 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，经公司董事会审议通过，聘任周雷为公司督察长。公司总经理黄小慧自 2020 年 5 月 20 日起不再代任督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：2019 年 11 月 20 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	9,965,905.64	36.60%	9,081.70	36.40%	-
招商证券	2	5,434,275.23	19.96%	4,952.22	19.85%	-
银河证券	1	3,125,785.09	11.48%	2,911.18	11.67%	-
海通证券	1	2,892,204.59	10.62%	2,693.62	10.80%	-
东方证券	2	913,747.72	3.36%	850.99	3.41%	-
东吴证券	1	623,168.86	2.29%	580.36	2.33%	-
中信建投	1	617,146.37	2.27%	562.27	2.25%	-
兴业证券	2	594,271.80	2.18%	541.64	2.17%	-
广发证券	2	569,794.31	2.09%	530.69	2.13%	-
华宝证券	1	508,614.84	1.87%	473.52	1.90%	-
瑞银证券	1	390,820.38	1.44%	363.91	1.46%	-
西部证券	1	300,398.00	1.10%	213.67	0.86%	-
中金国际	1	271,881.00	1.00%	253.24	1.01%	-

长江证券	1	265,328.40	0.97%	247.04	0.99%	-
安信证券	1	247,733.30	0.91%	230.79	0.92%	-
红塔证券	1	203,724.29	0.75%	189.76	0.76%	-
万联证券	1	120,718.40	0.44%	110.02	0.44%	-
国泰君安	2	86,133.30	0.32%	78.49	0.31%	-
天风证券	2	39,220.29	0.14%	36.10	0.14%	-
方正证券	2	20,574.66	0.08%	18.75	0.08%	-
华西证券	1	15,787.05	0.06%	14.39	0.06%	-
中信证券	2	11,569.92	0.04%	10.78	0.04%	-
中投证券	1	7,480.52	0.03%	6.97	0.03%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

日信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
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、本基金本报告期券商交易单元新增：申万宏源。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,316.21	100.00%	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2020-01-21
2	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-01-21
3	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场外申购（含定期定额投资）业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2020-03-03
4	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	基金管理人网站	2020-03-30
5	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-03-30
6	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2020-04-21
7	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、基金管理人网站	2020-05-06
8	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、基金管理人网站	2020-05-07
9	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、基金管理人网站	2020-05-08
10	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、基金管理人网站	2020-05-09
11	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、基金管理人网站	2020-05-12
12	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、基金管理人网站	2020-05-13
13	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、基金管理人网站	2020-05-15
14	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、基金管理人网站	2020-05-16

15	华宝基金管理有限公司关于旗下分级基金暂停场内份额分拆业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站	2020-05-16
16	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、基金管理人网站	2020-05-19
17	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、基金管理人网站	2020-05-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日