
华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
2021 年年度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 3 月 18 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§4 管理人报告	6
§5 托管人报告	12
§6 审计报告	13
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	75
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末上市基金前十名持有人	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
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	76
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息	81
§13 备查文件目录	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 1000ETF
场内简称	中证 1000ETF
基金主代码	159845
交易代码	159845
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 18 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	629,022,278.00 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	2021 年 3 月 31 日

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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，国债期货投资策略，股票期权投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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		华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	张燕
	联系电话	400-818-6666	0755-83199084
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		杨明辉	缪建民

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.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	25,307,035.73
本期利润	41,555,569.35
加权平均基金份额本期利润	0.1286
本期加权平均净值利润率	16.74%
本期基金份额净值增长率	32.37%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	70,023,789.87
期末可供分配基金份额利润	0.1113
期末基金资产净值	529,035,527.08
期末基金份额净值	0.8410
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	32.37%

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

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

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④本基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效。

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	8.70%	1.05%	8.17%	1.05%	0.53%	0.00%
过去六个月	15.22%	1.25%	13.08%	1.26%	2.14%	-0.01%
自基金合同生效起至今	32.37%	1.12%	27.60%	1.14%	4.77%	-0.02%

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

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 3 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日)



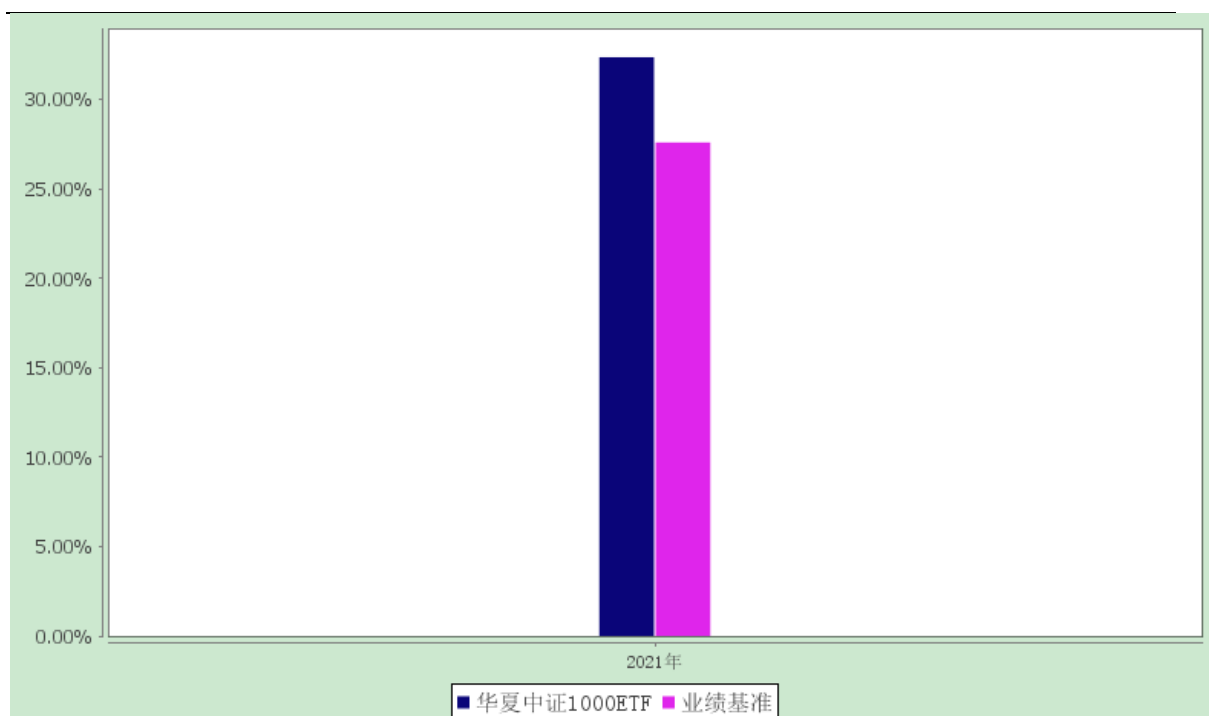
注：①本基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

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

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2021 年 3 月 18 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

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+ 基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接（A 类）排序第 3/14；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强（A 类）排序第 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接（A 类）排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接（A 类）排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证全指房地产 ETF 联接（A 类）排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接（A 类）排序第 8/27；在利率债指数债券型基金（A 类）中华夏中债 3-5 年政金债指数（A 类）排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证 500ETF 联接（A 类）排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）（A 类）排序第 4/25；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合（LOF）（A 类）排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合（A 类）排序第 26/231、华夏睿磐泰利混合（A 类）排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金（A 类）

中华夏鼎航债券(A类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金(A类)中华夏短债债券(A类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A类)排序第 32/203；在普通债券型基金(二级)(A类)中华夏鼎泓债券(A类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金(A类)中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A类)排序第 80/427。

养老&FOF 产品：在混合型 FOF（权益资产 0-30%）(A类)中华夏聚丰混合（FOF）(A类)排序第 1/16、华夏聚惠 FOF(A类)排序第 3/16；在养老目标日期 FOF（2040）(A类)中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/11。

在客户服务方面，2021 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线邮储银行卡直连、交通银行卡快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线人脸识别，盖章账单自动生成，非货基收益提醒及预约赎回等功能，提升了投资者业务办理的方便快捷性，在震荡的市场行情下方便投资者及时掌握基金收益情况，增加客户操作便利性；（3）与民商基金销售、众惠基金、泰信财富、排排网基金销售等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“震荡市需要口服镇心丸”、“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“牙掉了之后”、“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“华夏亲子财商营”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的基金经理	2021-03-18	-	13 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 73 次，其中 52 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 1000 指数，中证 1000 指数选取中证 800 指数样本以外的规模偏小且流动性好的 1000 只证券作为指数样本，与沪深 300 和中证 500 等指数形成互补。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2021 年，新冠疫情的反复使得全球经济复苏动能减弱，劳动力市场恢复缓慢，供给瓶颈凸显，形成全球经济复苏边际放缓与供应链摩擦加剧相叠加的局面，通胀预期升温，金融市场波动加大；为提前应对通货膨胀、汇率贬值、资本外流等压力，土耳其、巴西等部分新兴经济体从 1 季度就开始加息，美国等主要发达经济体则在 4 季度开始边际收紧货币政策以应对通胀持续走高。国内方面，我国在统筹经济发展和疫情防控方面取得的成效全球瞩目，经济社会发展总体稳定，在疫情冲击和宏观政策偏紧的背景下，经济走势前高后低，由于低基数逐渐消退、政策回归常态化，GDP 增速逐季下行；跨周期调节发力，稳增长政策加码，高质量发展取得新成效，实现了“十四五”良好开局。

市场方面，A 股市场 2021 年整体表现不错，万得全 A 指数上涨 9.17%，市场风格完全切换，小盘股整体表现优于大盘股，沪深 300 指数下跌 5.20%，中证 500 指数上涨 15.58%，中证 1000 指数上涨 20.52%。行业板块表现分化较大，新能源板块以及基础化工、有色金属、煤炭、钢铁等顺周期板块全年表现较好，大消费、金融地产、医药等板块表现落后。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括国盛证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国国际金融有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.8410 元，本报告期份额净值增长率为 32.37%，同期业绩比较基准增长率 27.60%。本基金本报告期跟踪偏离度为+4.77%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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 2022 年，随着疫苗接种加快与特效药面市，全球新冠疫情将可能逐步消退。国际方面，从基本面看，全球经济增速将放缓，IMF 预计 2021 年全球经济增速为 5.9%，2022 年下降至 4.4%，通

胀预计将维持高位,2022 年发达经济体的平均通胀率预计为 3.9%,新兴市场和发展中经济体为 5.9%;从政策面看,全球的货币环境已经收紧,随着价格和工资压力扩大,美联储决定加快缩减资产购买,并表示将在 2022 年进一步加息,超过先前预期,欧洲央行已宣布将于 2022 年 3 月停止在“紧急抗疫购债计划”下净购入资产,暂不会退出宽松政策,但仍难以加码。国内方面,从基本面看,房地产目前正在收缩,私人消费恢复慢于预期,影响中国经济增长前景,IMF 预测中国 2022 年和 2023 年 GDP 增速分别为 4.8%和 5.2%,较 2021 年 8.1%的增速有明显放缓,企业盈利增速也将有所下行,但在跨周期调节下,下行幅度可控;从政策面看,政策基调边际转松,稳增长意愿提升,货币政策偏松调节,但难以“大水漫灌”,市场流动性仍将维持合理充裕,剩余流动性 2022 年将保持温和大于零的状态。

市场方面,预计全年 A 股总体呈现震荡走势,但仍有结构性机会,成长股被热捧或有降温,价值股或有均值回复行情;以食品饮料、家用电器为代表的消费、医药以及金融等 2021 年表现较弱的板块有望取得相对更好的表现。此外,从历史来看,在政府换届的年份,A 股市场整体表现通常不会差。

本基金将会根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面,公司着力加强合规制度建设,在投资、销售、员工行为合规管理等方面出台多项管理制度。同时,继续强化业务部门专兼合规管理职责,规范任免流程,提高工作质量,完善合规管理组织机制。公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理,确保公司合规体系高效运行,合规风险有效控制。公司开展多种形式的法律法规和廉洁从业培训,提升员工的合规意识,促进廉洁从业。公司严格落实信息披露法规要求,依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面,公司秉承数字化管理理念,持续完善内部风险管理系统建设,稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时,持续完善风险管理制度建设,提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平,努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面,公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作,排查业务风险隐患,促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内,本基金管理人管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为

核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等信息的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24702 号

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏中证 1000ETF”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏中证 1000ETF 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏中证 1000ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏中证 1000ETF 的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏中证 1000ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏中证 1000ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏中证 1000ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏中证 1000ETF 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夏中证 1000ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 朱宏宇

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	1,544,412.34
结算备付金		226,182.88
存出保证金		67,583.97
交易性金融资产	7.4.7.2	527,707,027.37
其中：股票投资		527,666,924.17
基金投资		-
债券投资		40,103.20
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		71,583.95
应收利息	7.4.7.5	995.55
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		529,617,786.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 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		-
应付管理人报酬		148,885.39
应付托管费		29,777.09
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	110,514.70
应交税费		0.35
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	7.4.7.8	293,081.45
负债合计		582,258.98
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	399,648,535.55
未分配利润	7.4.7.10	129,386,991.53
所有者权益合计		529,035,527.08
负债和所有者权益总计		529,617,786.06

注：①报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8410 元，基金份额总额 629,022,278.00 份。

②本基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效，本报告期自 2021 年 3 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		43,931,342.79
1.利息收入		47,300.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	32,977.73
债券利息收入		59.10
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		14,263.69
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,336,602.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,127,257.52
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	86,134.28
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,123,210.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,248,533.62
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	1,298,906.55
减：二、费用		2,375,773.44
1. 管理人报酬		1,000,770.26
2. 托管费		200,154.07

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,023,943.97
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.14
7. 其他费用	7.4.7.20	150,905.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,555,569.35
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,555,569.35

注：本基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效，本报告期自 2021 年 3 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 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）	228,866,784.00	-	228,866,784.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,555,569.35	41,555,569.35
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）	170,781,751.55	87,831,422.18	258,613,173.73
其中：1.基金申购款	1,055,328,474.12	187,272,148.26	1,242,600,622.38
2.基金赎回款	-884,546,722.57	-99,440,726.08	-983,987,448.65
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）	399,648,535.55	129,386,991.53	529,035,527.08

注：本基金合同于 2021 年 3 月 18 日生效，本报告期自 2021 年 3 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日。

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：

基金管理人负责人：杨明辉 主管会计工作负责人：朱威 会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3523 号《关于准予华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2021 年 3 月 4 日至 2021 年 3 月 12 日共募集 228,854,522.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60739337_A41 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 228,866,784.00 份基金份额。根据《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2021 年 3 月 22 日为基金份额折算日，折算后本基金基金份额净值与 2021 年 3 月 22 日中证 1000 指数收盘点位的万分之一基本一致。折算前基金份额总额为 228,866,784 份，本次基金份额折算比例为 1.573946543，折算后基金份额总额为 360,222,278 份。基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板

第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间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。本会计报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

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

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

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经

实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

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

估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,544,412.34
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
合计	1,544,412.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		511,420,593.75	527,666,924.17	16,246,330.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	37,900.00	40,103.20	2,203.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	37,900.00	40,103.20	2,203.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		511,458,493.75	527,707,027.37	16,248,533.62

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	756.19
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	202.96
应收债券利息	2.96

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	33.44
合计	995.55

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	110,514.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	110,514.70

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	150,000.00
应退替代款	143,081.45
合计	293,081.45

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	228,866,784.00	228,866,784.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2021 年 3 月 23 日基金拆分/份额折算前	228,866,784.00	228,866,784.00

基金拆分/份额折算调整	131,355,494.00	—
本期申购	1,300,800,000.00	1,055,328,474.12
本期赎回（以“-”号填列）	-1,032,000,000.00	-884,546,722.57
本期末	629,022,278.00	399,648,535.55

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 228,854,522.00 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 12,262.00 元在本基金合同生效后，折算为 12,262.00 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	25,307,035.73	16,248,533.62	41,555,569.35
本期基金份额交易产生的变动数	44,716,754.14	43,114,668.04	87,831,422.18
其中：基金申购款	97,996,804.67	89,275,343.59	187,272,148.26
基金赎回款	-53,280,050.53	-46,160,675.55	-99,440,726.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,023,789.87	59,363,201.66	129,386,991.53

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,754.94
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	8,039.22
其他	2,183.57
合计	32,977.73

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,045,097.66
股票投资收益——赎回差价收入	10,082,159.86
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	25,127,257.52

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	450,660,084.82
减：卖出股票成本总额	435,614,987.16
买卖股票差价收入	15,045,097.66

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	755,120,664.65
减：现金支付赎回款总额	286,712,633.65
减：赎回股票成本总额	458,325,871.14
赎回差价收入	10,082,159.86

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	344,691.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	258,500.00
减：应收利息总额	57.32
买卖债券差价收入	86,134.28

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

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

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,123,210.30
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,123,210.30

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	16,248,533.62
——股票投资	16,246,330.42
——债券投资	2,203.20
——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	16,248,533.62

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,288,608.30
其他	10,298.25
合计	1,298,906.55

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	1,023,943.97
银行间市场交易费用	-
合计	1,023,943.97

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	905.00
合计	150,905.00

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，本基金无或有事项。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东

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 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	725,295,579.37	58.30%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	54,807.20	15.90%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

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 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021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
中信证券	264,069.50	59.63%	66,303.25	59.99%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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。

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 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,000,770.26
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	200,154.07	

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	121,761,302.00	19.36%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	1,544,412.34	22,754.94

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年3月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688235	百济神州	新股发行	3,603	693,937.80
中信证券	688739	成大生物	新股发行	2,655	292,050.00
中信证券	688211	中科微至	新股发行	2,025	182,655.00
中信证券	688176	亚虹医药	新股发行	7,779	178,761.42
中信证券	688192	迪哲医药	新股发行	3,012	158,370.96
中信证券	601825	沪农商行	新股发行	15,480	137,772.00
中信证券	601728	中国电信	新股发行	30,000	135,900.00
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	34,000	90,100.00
中信证券	688212	澳华内镜	新股发行	3,496	78,660.00
中信证券	300982	苏文电能	新股发行	3,170	50,181.10
中信证券	600955	维远股份	新股发行	1,694	50,074.64
中信证券	300993	玉马遮阳	新股发行	4,097	49,573.70
中信证券	300997	欢乐家	新股发行	7,211	35,622.34
中信证券	301049	超越科技	新股发行	1,807	34,947.38
中信证券	301028	东亚机械	新股发行	5,726	30,405.06
中信证券	603071	物产环能	新股发行	1,627	25,088.34
中信证券	301055	张小泉	新股发行	3,541	24,432.90
中信证券	605555	德昌股份	新股发行	655	21,189.25
中信证券	301059	金三江	新股发行	2,581	20,880.29
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	301053	远信工业	新股发行	1,544	18,327.28
中信证券	301062	上海艾录	新股发行	5,225	17,294.75
中信证券	605566	福莱蒾特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31

中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605020	永和股份	新股发行	850	5,890.50
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	688425	铁建重工	新股发行	1,000	2,870.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2021 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
688182	灿勤科技	2021-11-09	2022-05-16	新发流通受限	10.50	20.44	18,387	193,063.50	375,830.28	-
688162	巨一科技	2021-11-03	2022-05-10	新发流通受限	46.00	82.55	3,686	169,556.00	304,279.30	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新发流通受限	22.98	22.98	7,779	178,761.42	178,761.42	-
688103	国	2021-09-02	2022-03-10	新	12.04	66.10	1,595	19,203.80	105,429.50	-

	力股份			发 流 通 受 限						
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新发 流 通 受 限	14.14	89.87	338	4,779.32	30,376.06	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	新发 流 通 受 限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新发 流 通 受 限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新发 流 通 受 限	25.80	33.65	575	14,835.00	19,348.75	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新发 流 通 受 限	12.03	17.12	963	11,584.89	16,486.56	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新发 流 通 受 限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新发 流 通	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-

				受限						
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新发流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新发流通受限	11.90	45.45	305	3,629.50	13,862.25	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新发流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新发流通受限	8.86	23.80	536	4,748.96	12,756.80	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新发流通受限	43.99	50.77	235	10,337.65	11,930.95	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	10.64	30.44	360	3,830.40	10,958.40	-
301048	金	2021-08-11	2022-02-28	新	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-

	鹰重工			发 流 通 受 限						
301026	浩 通 科 技	2021-07-08	2022-01-17	新 发 流 通 受 限	18.03	62.73	168	3,029.04	10,538.64	-
301096	百 诚 医 药	2021-12-13	2022-06-20	新 发 流 通 受 限	79.60	78.53	126	10,029.60	9,894.78	-
301045	天 禄 科 技	2021-08-06	2022-02-17	新 发 流 通 受 限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301078	孩 子 王	2021-09-30	2022-04-14	新 发 流 通 受 限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上 海 艾 录	2021-09-07	2022-03-14	新 发 流 通 受 限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家 联 科 技	2021-12-02	2022-06-09	新 发 流 通 受 限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301025	读 客 文 化	2021-07-06	2022-01-24	新 发 流 通	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-

				受限						
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新发流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新发流通受限	57.27	53.71	146	8,361.42	7,841.66	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新发流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新发流通受限	5.31	13.50	573	3,042.63	7,735.50	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新发流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新发流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新发流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕	2021-07-15	2022-01-24	新	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

	净科技			发流通受限						
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新发流通受限	6.96	12.51	592	4,120.32	7,405.92	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新发流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新发流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新发流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新发流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新发流通	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

				受限						
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新发流通受限	19.34	32.92	181	3,500.54	5,958.52	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新发流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新发流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新发流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新发流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新发流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新发流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远	2021-08-25	2022-03-01	新	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

	信工业			发流通受限						
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新发流通受限	23.38	29.93	144	3,366.72	4,309.92	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新发流通受限	11.45	16.65	250	2,862.50	4,162.50	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新发流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新发流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新发流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127052	杭锅转	2021-12-24	2022-01-24	新发流	100.00	100.00	184	18,400.00	18,400.00	-

	债			通 受 限						
123133	佩 蒂 转 债	2021-12-22	2022-01-21	新 发 流 通 受 限	100.00	100.00	155	15,500.00	15,500.00	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600072	中船科技	2021-12-29	重大事项	14.65	2022-01-13	16.12	31,800	450,911.95	465,870.00	-

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	527,666,924.17	99.74
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	40,103.20	0.01
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	527,707,027.37	99.75

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-26,610,120.28
	+5%	26,610,120.28

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) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(2) 各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 526,449,067.11 元，第二层次的余额为 1,257,960.26 元，第三层次的余额为 0 元。

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

(4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(5) 新金融工具准则

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金

融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	527,666,924.17	99.63
	其中:股票	527,666,924.17	99.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,103.20	0.01
	其中:债券	40,103.20	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	1,770,595.22	0.33
8	其他各项资产	140,163.47	0.03
9	合计	529,617,786.06	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	3,623,267.00	0.68
B	采矿业	14,581,961.00	2.76
C	制造业	378,563,672.30	71.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,622,927.20	2.58
E	建筑业	7,784,394.99	1.47
F	批发和零售业	13,424,501.70	2.54

G	交通运输、仓储和邮政业	8,192,064.00	1.55
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,384,050.80	8.77
J	金融业	7,582,970.00	1.43
K	房地产业	9,047,842.00	1.71
L	租赁和商务服务业	3,463,089.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	7,900,387.59	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	7,553,097.45	1.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	60,900.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,721,768.50	0.33
R	文化、体育和娱乐业	3,703,188.64	0.70
S	综合	452,234.00	0.09
	合计	527,666,924.17	99.74

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	300012	华测检测	120,400	3,235,148.00	0.61
2	002176	江特电机	123,000	2,553,480.00	0.48
3	002240	盛新锂能	43,600	2,526,620.00	0.48
4	002497	雅化集团	83,100	2,381,646.00	0.45
5	600499	科达制造	95,300	2,365,346.00	0.45
6	603026	石大胜华	11,700	2,316,483.00	0.44
7	601058	赛轮轮胎	154,500	2,285,055.00	0.43
8	002326	永太科技	44,300	2,268,603.00	0.43
9	002625	光启技术	93,100	2,235,331.00	0.42
10	300073	当升科技	25,500	2,215,185.00	0.42
11	300769	德方纳米	4,500	2,210,220.00	0.42
12	002756	永兴材料	14,600	2,161,092.00	0.41
13	300390	天华超净	25,200	2,041,200.00	0.39
14	300568	星源材质	55,296	2,031,022.08	0.38
15	688116	天奈科技	13,530	2,019,893.70	0.38
16	002407	多氟多	44,100	1,984,059.00	0.38
17	002192	融捷股份	14,900	1,939,235.00	0.37
18	002036	联创电子	76,600	1,858,316.00	0.35
19	688122	西部超导	19,123	1,853,783.62	0.35
20	002402	和而泰	65,800	1,804,894.00	0.34
21	601677	明泰铝业	39,300	1,732,737.00	0.33
22	600711	盛屯矿业	158,400	1,699,632.00	0.32
23	000591	太阳能	151,600	1,697,920.00	0.32
24	300118	东方日升	51,900	1,685,193.00	0.32

25	000831	五矿稀土	42,400	1,654,448.00	0.31
26	002025	航天电器	19,600	1,645,420.00	0.31
27	002245	蔚蓝锂芯	59,700	1,642,347.00	0.31
28	300725	药石科技	11,480	1,632,111.60	0.31
29	688598	金博股份	4,586	1,628,213.44	0.31
30	002850	科达利	10,100	1,619,434.00	0.31
31	000423	东阿阿胶	33,000	1,608,750.00	0.30
32	600110	诺德股份	100,700	1,606,165.00	0.30
33	000762	西藏矿业	30,000	1,593,900.00	0.30
34	002463	沪电股份	95,600	1,585,048.00	0.30
35	600096	云天化	79,400	1,557,828.00	0.29
36	600771	广誉远	35,500	1,528,630.00	0.29
37	603606	东方电缆	29,700	1,519,452.00	0.29
38	002610	爱康科技	322,700	1,516,690.00	0.29
39	603678	火炬电子	19,900	1,505,435.00	0.28
40	300604	长川科技	26,080	1,499,600.00	0.28
41	002436	兴森科技	107,100	1,499,400.00	0.28
42	603236	移远通信	7,340	1,496,626.00	0.28
43	600338	西藏珠峰	39,500	1,487,570.00	0.28
44	600456	宝钛股份	20,700	1,485,846.00	0.28
45	000818	航锦科技	39,100	1,451,001.00	0.27
46	688388	嘉元科技	11,557	1,450,981.35	0.27
47	688390	固德威	3,145	1,445,379.10	0.27
48	600559	老白干酒	51,700	1,444,498.00	0.27
49	000860	顺鑫农业	37,400	1,427,932.00	0.27
50	000155	川能动力	52,200	1,384,866.00	0.26
51	600641	万业企业	41,400	1,377,378.00	0.26
52	002456	欧菲光	141,000	1,367,700.00	0.26
53	002585	双星新材	50,000	1,354,000.00	0.26
54	000683	远兴能源	185,200	1,351,960.00	0.26
55	002139	拓邦股份	71,400	1,334,466.00	0.25
56	002312	川发龙蟒	101,600	1,328,928.00	0.25
57	002738	中矿资源	18,600	1,308,696.00	0.25
58	300339	润和软件	57,400	1,306,998.00	0.25
59	603005	晶方科技	23,540	1,296,818.60	0.25
60	300395	菲利华	19,500	1,281,930.00	0.24
61	000516	ST 国医	114,750	1,265,692.50	0.24
62	601222	林洋能源	103,900	1,260,307.00	0.24
63	002531	天顺风能	64,900	1,258,411.00	0.24
64	300777	中简科技	20,200	1,249,976.00	0.24
65	300850	新强联	7,000	1,249,570.00	0.24
66	600882	妙可蓝多	22,300	1,248,800.00	0.24
67	002597	金禾实业	24,300	1,247,805.00	0.24
68	300373	扬杰科技	18,400	1,236,112.00	0.23

69	002617	露笑科技	80,800	1,228,160.00	0.23
70	002558	巨人网络	102,100	1,222,137.00	0.23
71	300327	中颖电子	17,890	1,214,731.00	0.23
72	300458	全志科技	19,100	1,208,648.00	0.23
73	300672	国科微	6,500	1,205,750.00	0.23
74	600873	梅花生物	156,200	1,198,054.00	0.23
75	002389	航天彩虹	42,700	1,187,060.00	0.22
76	600596	新安股份	47,200	1,179,528.00	0.22
77	300054	鼎龙股份	47,400	1,153,716.00	0.22
78	300726	宏达电子	11,500	1,150,690.00	0.22
79	300748	金力永磁	25,600	1,149,184.00	0.22
80	300502	新易盛	29,182	1,143,350.76	0.22
81	300346	南大光电	24,300	1,128,492.00	0.21
82	300476	胜宏科技	37,300	1,128,325.00	0.21
83	300035	中科电气	37,000	1,119,250.00	0.21
84	002145	中核钛白	88,800	1,117,992.00	0.21
85	300679	电连技术	21,250	1,115,625.00	0.21
86	300682	朗新科技	30,000	1,110,900.00	0.21
87	688200	华峰测控	2,160	1,105,704.00	0.21
88	605111	新洁能	6,200	1,104,220.00	0.21
89	300083	创世纪	77,000	1,099,560.00	0.21
90	000875	吉电股份	120,500	1,095,345.00	0.21
91	600416	湘电股份	49,900	1,092,311.00	0.21
92	688202	美迪西	2,178	1,057,615.02	0.20
93	300775	三角防务	21,400	1,046,246.00	0.20
94	000933	神火股份	113,500	1,031,715.00	0.20
95	688301	奕瑞科技	2,074	1,030,570.60	0.19
96	688139	海尔生物	11,331	1,029,081.42	0.19
97	002541	鸿路钢构	19,200	1,027,968.00	0.19
98	688408	中信博	5,820	1,027,288.20	0.19
99	603596	伯特利	14,700	1,023,120.00	0.19
100	600100	同方股份	168,900	1,018,467.00	0.19
101	300438	鹏辉能源	21,500	1,015,660.00	0.19
102	300567	精测电子	14,000	1,014,020.00	0.19
103	605117	德业股份	3,700	1,013,023.00	0.19
104	002151	北斗星通	25,800	1,012,650.00	0.19
105	300034	钢研高纳	17,500	1,008,000.00	0.19
106	300623	捷捷微电	31,900	1,003,574.00	0.19
107	600151	航天机电	72,400	1,002,740.00	0.19
108	600773	西藏城投	35,400	1,000,404.00	0.19
109	688298	东方生物	4,288	988,384.00	0.19
110	002747	埃斯顿	37,500	973,125.00	0.18
111	002484	江海股份	35,600	972,592.00	0.18
112	300776	帝尔激光	3,800	972,420.00	0.18

113	300379	东方通	32,740	966,812.20	0.18
114	601258	庞大集团	589,300	966,452.00	0.18
115	600378	昊华科技	19,898	959,083.60	0.18
116	600179	安通控股	251,400	957,834.00	0.18
117	601908	京运通	104,300	956,431.00	0.18
118	000829	天音控股	51,700	953,348.00	0.18
119	002643	万润股份	40,200	950,328.00	0.18
120	688050	爱博医疗	4,509	947,927.07	0.18
121	300432	富临精工	32,200	946,680.00	0.18
122	603588	高能环境	53,550	940,873.50	0.18
123	603129	春风动力	5,400	934,200.00	0.18
124	600330	天通股份	57,400	931,602.00	0.18
125	002091	江苏国泰	67,600	928,148.00	0.18
126	300747	锐科激光	15,650	925,071.50	0.17
127	300767	震安科技	8,800	918,280.00	0.17
128	002706	良信股份	51,410	916,126.20	0.17
129	300171	东富龙	18,100	914,774.00	0.17
130	002810	山东赫达	14,830	913,083.10	0.17
131	300079	数码视讯	102,900	908,607.00	0.17
132	601678	滨化股份	112,800	899,016.00	0.17
133	300393	中来股份	47,160	897,926.40	0.17
134	600777	新潮能源	391,800	893,304.00	0.17
135	300151	昌红科技	21,700	887,530.00	0.17
136	000503	国新健康	52,300	883,870.00	0.17
137	002318	久立特材	49,300	881,484.00	0.17
138	300451	创业慧康	78,180	874,052.40	0.17
139	300457	赢合科技	28,100	863,232.00	0.16
140	601375	中原证券	173,900	853,849.00	0.16
141	600577	精达股份	114,600	852,624.00	0.16
142	300294	博雅生物	22,100	847,535.00	0.16
143	300685	艾德生物	11,200	845,712.00	0.16
144	688023	安恒信息	3,366	843,990.84	0.16
145	300671	富满微	10,400	842,920.00	0.16
146	300036	超图软件	28,000	841,400.00	0.16
147	300773	拉卡拉	28,800	835,776.00	0.16
148	603027	千禾味业	34,540	831,723.20	0.16
149	600273	嘉化能源	71,600	828,412.00	0.16
150	002727	一心堂	21,500	827,965.00	0.16
151	601399	国机重装	209,500	827,525.00	0.16
152	601567	三星医疗	49,900	813,869.00	0.15
153	600363	联创光电	26,200	813,248.00	0.15
154	600277	亿利洁能	153,850	810,789.50	0.15
155	300409	道氏技术	33,400	809,950.00	0.15
156	300185	通裕重工	224,600	808,560.00	0.15

157	300638	广和通	14,830	808,235.00	0.15
158	688339	亿华通	2,977	806,320.45	0.15
159	002851	麦格米特	25,100	803,702.00	0.15
160	600986	浙文互联	95,300	803,379.00	0.15
161	600210	紫江企业	87,400	802,332.00	0.15
162	601777	力帆科技	129,600	802,224.00	0.15
163	603688	石英股份	12,700	801,497.00	0.15
164	002123	梦网科技	46,200	794,640.00	0.15
165	000902	新洋丰	47,000	793,830.00	0.15
166	300487	蓝晓科技	8,000	786,800.00	0.15
167	601208	东材科技	45,300	785,955.00	0.15
168	603599	广信股份	20,100	783,900.00	0.15
169	601311	骆驼股份	50,700	777,231.00	0.15
170	603128	华贸物流	56,600	774,288.00	0.15
171	603906	龙蟠科技	20,900	774,136.00	0.15
172	600252	中恒集团	200,300	773,158.00	0.15
173	603690	至纯科技	16,000	770,400.00	0.15
174	603308	应流股份	34,500	770,040.00	0.15
175	002258	利尔化学	22,800	769,044.00	0.15
176	000035	中国天楹	127,300	765,073.00	0.14
177	603008	喜临门	19,600	764,988.00	0.14
178	002171	楚江新材	57,600	763,776.00	0.14
179	002063	远光软件	76,220	757,626.80	0.14
180	000049	德赛电池	12,930	754,077.60	0.14
181	600587	新华医疗	23,400	753,480.00	0.14
182	002332	仙琚制药	57,000	752,400.00	0.14
183	000650	仁和药业	80,600	751,192.00	0.14
184	688033	天宜上佳	22,650	748,582.50	0.14
185	002182	云海金属	32,600	747,844.00	0.14
186	600323	瀚蓝环境	35,300	740,594.00	0.14
187	600055	万东医疗	31,100	740,491.00	0.14
188	000403	派林生物	26,400	739,992.00	0.14
189	600850	电科数字	21,600	737,208.00	0.14
190	688333	铂力特	3,459	736,767.00	0.14
191	600812	华北制药	61,800	736,656.00	0.14
192	601126	四方股份	35,200	735,680.00	0.14
193	600583	海油工程	159,300	734,373.00	0.14
194	002675	东诚药业	46,300	730,614.00	0.14
195	600459	贵研铂业	28,690	730,160.50	0.14
196	300298	三诺生物	24,400	729,804.00	0.14
197	002960	青鸟消防	15,018	729,123.90	0.14
198	603098	森特股份	15,500	728,035.00	0.14
199	002335	科华数据	20,000	727,200.00	0.14
200	002413	雷科防务	96,600	717,738.00	0.14

201	002126	银轮股份	57,100	717,176.00	0.14
202	300101	振芯科技	32,200	714,196.00	0.13
203	000951	中国重汽	42,240	713,433.60	0.13
204	601666	平煤股份	84,600	708,102.00	0.13
205	603179	新泉股份	16,200	701,136.00	0.13
206	300613	富瀚微	4,299	700,951.95	0.13
207	002544	杰赛科技	29,500	700,330.00	0.13
208	300068	南都电源	49,400	699,504.00	0.13
209	600206	有研新材	42,700	699,426.00	0.13
210	300188	美亚柏科	40,600	697,914.00	0.13
211	300087	荃银高科	22,885	695,704.00	0.13
212	002626	金达威	22,200	695,526.00	0.13
213	688516	奥特维	2,821	693,176.12	0.13
214	300803	指南针	17,500	692,475.00	0.13
215	600305	恒顺醋业	43,300	690,635.00	0.13
216	600685	中船防务	29,600	690,568.00	0.13
217	000917	电广传媒	102,100	690,196.00	0.13
218	600977	中国电影	53,800	689,178.00	0.13
219	603520	司太立	10,600	689,000.00	0.13
220	603279	景津装备	14,800	686,424.00	0.13
221	002214	大立科技	34,600	683,004.00	0.13
222	603583	捷昌驱动	13,760	682,908.80	0.13
223	300674	宇信科技	28,540	682,106.00	0.13
224	002254	泰和新材	34,500	676,545.00	0.13
225	600877	声光电科	43,100	674,946.00	0.13
226	600483	福能股份	41,400	673,992.00	0.13
227	002099	海翔药业	81,700	673,208.00	0.13
228	300737	科顺股份	41,280	670,800.00	0.13
229	601137	博威合金	28,400	670,240.00	0.13
230	300861	美畅股份	8,600	668,822.00	0.13
231	600586	金晶科技	72,100	667,646.00	0.13
232	002984	森麒麟	18,700	665,159.00	0.13
233	600688	上海石化	158,400	660,528.00	0.12
234	603039	泛微网络	9,456	659,745.12	0.12
235	600057	厦门象屿	77,700	659,673.00	0.12
236	600366	宁波韵升	49,900	659,179.00	0.12
237	600562	国睿科技	35,800	658,004.00	0.12
238	603876	鼎胜新材	17,400	655,110.00	0.12
239	002041	登海种业	25,400	655,066.00	0.12
240	002291	星期六	32,800	654,688.00	0.12
241	300233	金城医药	22,400	651,616.00	0.12
242	601212	白银有色	213,400	650,870.00	0.12
243	300348	长亮科技	41,500	650,305.00	0.12
244	300055	万邦达	49,900	649,698.00	0.12

245	601369	陕鼓动力	49,800	648,396.00	0.12
246	300323	华灿光电	53,600	646,416.00	0.12
247	300203	聚光科技	22,800	644,328.00	0.12
248	600116	三峡水利	55,100	642,466.00	0.12
249	002015	协鑫能科	39,000	641,940.00	0.12
250	002216	三全食品	31,750	641,667.50	0.12
251	300369	绿盟科技	40,200	637,572.00	0.12
252	300027	华谊兄弟	160,200	634,392.00	0.12
253	603713	密尔克卫	4,700	633,466.00	0.12
254	600129	太极集团	28,100	631,126.00	0.12
255	600246	万通发展	59,200	631,072.00	0.12
256	300398	飞凯材料	26,000	628,160.00	0.12
257	600993	马应龙	21,800	626,968.00	0.12
258	300131	英唐智控	77,000	626,780.00	0.12
259	688016	心脉医疗	2,515	625,581.10	0.12
260	688018	乐鑫科技	3,287	624,661.48	0.12
261	000657	中钨高新	38,700	622,296.00	0.12
262	603733	仙鹤股份	15,200	620,312.00	0.12
263	600963	岳阳林纸	78,000	614,640.00	0.12
264	300031	宝通科技	22,300	614,365.00	0.12
265	300224	正海磁材	35,500	606,340.00	0.11
266	002097	山河智能	62,700	606,309.00	0.11
267	002832	比音勒芬	23,800	605,710.00	0.11
268	688266	泽璟制药	10,292	605,169.60	0.11
269	600075	新疆天业	73,400	603,348.00	0.11
270	002807	江阴银行	156,400	602,140.00	0.11
271	600267	海正药业	43,000	601,570.00	0.11
272	688017	绿的谐波	3,442	600,835.52	0.11
273	002839	张家港行	104,200	600,192.00	0.11
274	002130	沃尔核材	72,600	598,950.00	0.11
275	600966	博汇纸业	57,800	597,652.00	0.11
276	002239	奥特佳	163,600	597,140.00	0.11
277	600063	皖维高新	97,100	595,223.00	0.11
278	002023	海特高新	43,700	594,757.00	0.11
279	002261	拓维信息	72,000	594,000.00	0.11
280	603565	中谷物流	20,800	590,512.00	0.11
281	600481	双良节能	58,600	589,516.00	0.11
282	000727	冠捷科技	195,700	589,057.00	0.11
283	000672	上峰水泥	29,300	588,051.00	0.11
284	603489	八方股份	2,600	586,560.00	0.11
285	603187	海容冷链	12,300	583,635.00	0.11
286	688106	金宏气体	20,969	583,147.89	0.11
287	600185	格力地产	84,100	581,131.00	0.11
288	000893	亚钾国际	21,800	580,970.00	0.11

289	002639	雪人股份	39,000	579,930.00	0.11
290	002539	云图控股	43,700	579,899.00	0.11
291	601001	晋控煤业	60,300	579,483.00	0.11
292	000426	兴业矿业	79,400	574,856.00	0.11
293	600740	山西焦化	92,290	573,120.90	0.11
294	600682	南京新百	48,500	570,360.00	0.11
295	002262	恩华药业	36,332	568,595.80	0.11
296	600328	中盐化工	34,500	566,145.00	0.11
297	002906	华阳集团	10,300	566,088.00	0.11
298	300319	麦捷科技	36,900	564,570.00	0.11
299	603919	金徽酒	14,600	563,706.00	0.11
300	688007	光峰科技	16,379	562,618.65	0.11
301	300573	兴齐眼药	4,100	560,880.00	0.11
302	688508	芯朋微	4,837	560,414.82	0.11
303	002108	沧州明珠	71,500	559,130.00	0.11
304	000969	安泰科技	51,700	553,707.00	0.10
305	300326	凯利泰	51,900	553,254.00	0.10
306	600197	伊力特	20,400	553,248.00	0.10
307	603979	金诚信	25,700	552,036.00	0.10
308	300236	上海新阳	13,500	551,475.00	0.10
309	002022	科华生物	37,100	550,564.00	0.10
310	002859	洁美科技	14,800	550,560.00	0.10
311	002079	苏州固锝	40,700	549,450.00	0.10
312	002217	合力泰	157,200	548,628.00	0.10
313	002206	海利得	61,700	547,896.00	0.10
314	688166	博瑞医药	14,851	545,180.21	0.10
315	002163	海南发展	46,300	544,025.00	0.10
316	600490	鹏欣资源	111,600	543,492.00	0.10
317	300841	康华生物	2,550	542,436.00	0.10
318	600320	振华重工	143,600	541,372.00	0.10
319	002283	天润工业	57,300	540,912.00	0.10
320	002773	康弘药业	26,500	539,275.00	0.10
321	601519	大智慧	73,100	538,747.00	0.10
322	300065	海兰信	35,300	538,678.00	0.10
323	601028	玉龙股份	28,200	536,928.00	0.10
324	300470	中密控股	12,000	536,040.00	0.10
325	300377	赢时胜	43,300	535,621.00	0.10
326	002425	凯撒文化	55,200	532,128.00	0.10
327	601965	中国汽研	28,500	530,385.00	0.10
328	002556	辉隆股份	41,200	530,244.00	0.10
329	000612	焦作万方	68,700	529,677.00	0.10
330	000546	金圆股份	39,400	529,142.00	0.10
331	300662	科锐国际	8,500	528,785.00	0.10
332	000034	神州数码	33,400	528,722.00	0.10

333	600621	华鑫股份	38,200	528,688.00	0.10
334	600635	大众公用	139,400	528,326.00	0.10
335	000016	深康佳 A	80,500	527,275.00	0.10
336	002100	天康生物	48,800	522,160.00	0.10
337	688198	佰仁医疗	2,050	521,315.00	0.10
338	002274	华昌化工	41,100	520,737.00	0.10
339	688019	安集科技	1,902	519,626.40	0.10
340	002567	唐人神	69,500	519,165.00	0.10
341	600285	羚锐制药	32,800	518,240.00	0.10
342	300456	赛微电子	21,100	518,216.00	0.10
343	002135	东南网架	44,800	517,888.00	0.10
344	300497	富祥药业	31,700	517,661.00	0.10
345	002324	普利特	36,540	515,944.80	0.10
346	600552	凯盛科技	44,000	515,680.00	0.10
347	002400	省广集团	100,500	515,565.00	0.10
348	600295	鄂尔多斯	21,800	514,262.00	0.10
349	300394	天孚通信	14,020	513,132.00	0.10
350	000976	华铁股份	91,900	510,045.00	0.10
351	300666	江丰电子	9,700	510,026.00	0.10
352	603997	继峰股份	31,700	509,736.00	0.10
353	300352	北信源	83,500	509,350.00	0.10
354	000712	锦龙股份	32,300	508,725.00	0.10
355	601918	新集能源	112,000	508,480.00	0.10
356	002581	未名医药	23,800	508,130.00	0.10
357	688037	芯源微	3,007	507,581.60	0.10
358	300855	图南股份	7,200	507,528.00	0.10
359	300287	飞利信	82,700	506,951.00	0.10
360	002759	天际股份	17,300	506,890.00	0.10
361	000848	承德露露	46,600	505,610.00	0.10
362	002612	朗姿股份	15,900	504,189.00	0.10
363	300770	新媒股份	8,400	504,000.00	0.10
364	002534	杭锅股份	15,900	503,871.00	0.10
365	000059	华锦股份	69,200	503,776.00	0.10
366	603113	金能科技	30,900	503,670.00	0.10
367	600797	浙大网新	74,000	503,200.00	0.10
368	600360	华微电子	55,300	502,124.00	0.09
369	300627	华测导航	10,900	501,400.00	0.09
370	000767	晋控电力	133,000	500,080.00	0.09
371	300355	蒙草生态	92,400	498,960.00	0.09
372	300663	科蓝软件	23,500	498,435.00	0.09
373	002649	博彦科技	42,600	497,568.00	0.09
374	002498	汉缆股份	95,900	495,803.00	0.09
375	688027	国盾量子	2,859	495,750.60	0.09
376	000811	冰轮环境	32,200	495,558.00	0.09

377	300075	数字政通	27,500	495,000.00	0.09
378	600496	精工钢构	116,000	494,160.00	0.09
379	000921	海信家电	32,600	493,890.00	0.09
380	300007	汉威科技	16,300	492,586.00	0.09
381	002837	英维克	12,000	490,680.00	0.09
382	000682	东方电子	57,900	490,413.00	0.09
383	600578	京能电力	145,600	489,216.00	0.09
384	002726	龙大美食	46,600	487,436.00	0.09
385	688158	优刻得	18,331	486,138.12	0.09
386	300702	天宇股份	10,040	485,434.00	0.09
387	603305	旭升股份	9,700	483,836.00	0.09
388	300219	鸿利智汇	30,576	483,406.56	0.09
389	002237	恒邦股份	41,300	482,797.00	0.09
390	600223	鲁商发展	36,400	482,300.00	0.09
391	600059	古越龙山	39,400	481,862.00	0.09
392	002698	博实股份	36,800	479,872.00	0.09
393	605376	博迁新材	5,700	478,971.00	0.09
394	688066	航天宏图	6,574	477,929.80	0.09
395	688277	天智航	18,204	477,855.00	0.09
396	603989	艾华集团	11,500	476,100.00	0.09
397	300973	立高食品	3,600	475,488.00	0.09
398	002467	二六三	98,300	473,806.00	0.09
399	000582	北部湾港	58,900	473,556.00	0.09
400	300821	东岳硅材	25,900	473,452.00	0.09
401	601952	苏垦农发	39,700	472,827.00	0.09
402	000735	罗牛山	66,300	472,719.00	0.09
403	000923	河钢资源	33,000	471,900.00	0.09
404	600211	西藏药业	9,000	471,240.00	0.09
405	000627	天茂集团	142,300	471,013.00	0.09
406	002276	万马股份	52,200	470,322.00	0.09
407	300263	隆华科技	46,100	470,220.00	0.09
408	002106	莱宝高科	40,700	468,457.00	0.09
409	600984	建设机械	41,800	468,160.00	0.09
410	300525	博思软件	20,020	468,067.60	0.09
411	300303	聚飞光电	77,400	467,496.00	0.09
412	600761	安徽合力	37,300	466,623.00	0.09
413	600072	中船科技	31,800	465,870.00	0.09
414	002222	福晶科技	24,600	465,678.00	0.09
415	300184	力源信息	67,100	465,674.00	0.09
416	600720	祁连山	44,700	464,880.00	0.09
417	600391	航发科技	16,600	464,800.00	0.09
418	300222	科大智能	39,300	464,133.00	0.09
419	300633	开立医疗	14,500	462,985.00	0.09
420	600123	兰花科创	49,400	462,878.00	0.09

421	000927	中国铁物	130,700	462,678.00	0.09
422	600742	一汽富维	38,600	461,656.00	0.09
423	300123	亚光科技	50,800	460,756.00	0.09
424	002928	华夏航空	36,500	459,900.00	0.09
425	300102	乾照光电	51,000	458,490.00	0.09
426	600864	哈投股份	74,900	457,639.00	0.09
427	002481	双塔食品	53,700	457,524.00	0.09
428	300696	爱乐达	8,800	457,072.00	0.09
429	300602	飞荣达	18,200	457,002.00	0.09
430	300143	盈康生命	32,300	456,076.00	0.09
431	600491	龙元建设	66,100	455,429.00	0.09
432	002226	江南化工	76,280	453,866.00	0.09
433	000543	皖能电力	81,600	453,696.00	0.09
434	600770	综艺股份	56,600	452,234.00	0.09
435	002428	云南锗业	37,654	451,848.00	0.09
436	603393	新天然气	18,320	451,221.60	0.09
437	300755	华致酒行	9,000	450,720.00	0.09
438	601890	亚星锚链	48,400	449,636.00	0.08
439	601619	嘉泽新能	87,100	449,436.00	0.08
440	000555	神州信息	35,300	449,016.00	0.08
441	300226	上海钢联	11,000	447,150.00	0.08
442	002967	广电计量	16,500	446,820.00	0.08
443	300180	华峰超纤	88,800	446,664.00	0.08
444	688368	晶丰明源	1,390	444,939.00	0.08
445	300659	中孚信息	9,800	444,430.00	0.08
446	603348	文灿股份	7,600	443,916.00	0.08
447	002488	金固股份	50,500	443,390.00	0.08
448	603323	苏农银行	91,000	443,170.00	0.08
449	603936	博敏电子	25,700	442,040.00	0.08
450	600452	涪陵电力	21,940	441,871.60	0.08
451	300598	诚迈科技	6,900	441,531.00	0.08
452	600389	江山股份	10,700	439,984.00	0.08
453	603881	数据港	11,900	439,348.00	0.08
454	300170	汉得信息	50,900	437,231.00	0.08
455	300639	凯普生物	14,805	436,895.55	0.08
456	002777	久远银海	15,800	436,870.00	0.08
457	002190	成飞集成	12,900	435,633.00	0.08
458	002020	京新药业	45,740	434,987.40	0.08
459	002293	罗莱生活	30,300	434,199.00	0.08
460	603686	福龙马	29,900	429,364.00	0.08
461	603298	杭叉集团	25,000	428,750.00	0.08
462	002611	东方精工	76,800	428,544.00	0.08
463	000676	智度股份	55,100	428,127.00	0.08
464	603429	集友股份	16,400	428,040.00	0.08

465	601011	宝泰隆	80,900	427,961.00	0.08
466	000928	中钢国际	46,000	427,800.00	0.08
467	600105	永鼎股份	79,600	427,452.00	0.08
468	002421	达实智能	110,700	427,302.00	0.08
469	603718	海利生物	27,800	425,340.00	0.08
470	000615	奥园美谷	39,400	424,732.00	0.08
471	300158	振东制药	51,800	424,242.00	0.08
472	000801	四川九洲	44,200	423,878.00	0.08
473	002201	正威新材	20,140	423,342.80	0.08
474	000793	华闻集团	143,900	423,066.00	0.08
475	300232	洲明科技	47,300	422,862.00	0.08
476	002833	弘亚数控	13,140	422,845.20	0.08
477	605168	三人行	2,500	422,475.00	0.08
478	300267	尔康制药	89,100	422,334.00	0.08
479	600422	昆药集团	38,200	422,110.00	0.08
480	600612	老凤祥	9,200	421,820.00	0.08
481	002518	科士达	16,800	421,680.00	0.08
482	000789	万年青	34,480	421,345.60	0.08
483	603301	振德医疗	8,200	421,234.00	0.08
484	300735	光弘科技	27,900	420,453.00	0.08
485	300406	九强生物	21,200	420,184.00	0.08
486	300709	精研科技	7,000	419,650.00	0.08
487	000795	英洛华	49,000	418,950.00	0.08
488	002635	安洁科技	24,600	418,938.00	0.08
489	002930	宏川智慧	16,100	416,185.00	0.08
490	000901	航天科技	40,200	415,266.00	0.08
491	300624	万兴科技	7,500	413,325.00	0.08
492	600169	太原重工	144,000	413,280.00	0.08
493	603068	博通集成	7,700	412,412.00	0.08
494	000915	华特达因	13,500	411,210.00	0.08
495	603960	克来机电	11,300	411,094.00	0.08
496	300053	欧比特	40,400	410,868.00	0.08
497	002158	汉钟精机	15,400	410,102.00	0.08
498	002614	奥佳华	31,800	409,584.00	0.08
499	603612	索通发展	19,900	408,348.00	0.08
500	603766	隆鑫通用	74,000	407,740.00	0.08
501	300091	金通灵	64,400	406,364.00	0.08
502	300119	瑞普生物	16,800	405,216.00	0.08
503	300177	中海达	42,800	404,888.00	0.08
504	000966	长源电力	55,100	403,883.00	0.08
505	002310	东方园林	135,400	403,492.00	0.08
506	603018	华设集团	48,160	402,617.60	0.08
507	603368	柳药股份	21,100	401,744.00	0.08
508	000935	四川双马	16,500	400,950.00	0.08

509	600458	时代新材	28,900	400,265.00	0.08
510	300401	花园生物	27,800	399,764.00	0.08
511	300596	利安隆	8,900	398,364.00	0.08
512	300149	睿智医药	28,800	397,728.00	0.08
513	603915	国茂股份	10,200	396,780.00	0.08
514	002446	盛路通信	65,500	396,275.00	0.07
515	600108	亚盛集团	112,200	396,066.00	0.07
516	002055	得润电子	27,000	394,470.00	0.07
517	000539	粤电力 A	64,100	394,215.00	0.07
518	600750	江中药业	27,200	393,040.00	0.07
519	603043	广州酒家	16,311	392,442.66	0.07
520	603108	润达医疗	29,200	391,572.00	0.07
521	688586	江航装备	11,542	391,273.80	0.07
522	300085	银之杰	25,500	390,660.00	0.07
523	002746	仙坛股份	37,200	390,228.00	0.07
524	603601	再升科技	31,400	389,674.00	0.07
525	600428	中远海特	77,300	389,592.00	0.07
526	603916	苏博特	15,120	389,491.20	0.07
527	002043	兔宝宝	32,200	388,976.00	0.07
528	600990	四创电子	6,900	387,573.00	0.07
529	300762	上海瀚讯	14,120	387,170.40	0.07
530	600751	海航科技	129,800	386,804.00	0.07
531	603826	坤彩科技	10,100	386,628.00	0.07
532	002449	国星光电	35,700	384,846.00	0.07
533	600477	杭萧钢构	93,100	384,503.00	0.07
534	002733	雄韬股份	16,600	383,958.00	0.07
535	600420	国药现代	37,000	383,690.00	0.07
536	300768	迪普科技	9,300	383,625.00	0.07
537	603896	寿仙谷	6,600	382,800.00	0.07
538	600073	上海梅林	47,300	382,657.00	0.07
539	601015	陕西黑猫	58,900	381,672.00	0.07
540	600343	航天动力	27,600	380,880.00	0.07
541	600789	鲁抗医药	50,700	379,743.00	0.07
542	600531	豫光金铅	62,800	378,684.00	0.07
543	600217	中再资环	50,000	378,500.00	0.07
544	300109	新开源	17,300	377,140.00	0.07
545	000030	富奥股份	50,800	376,936.00	0.07
546	300114	中航电测	21,300	376,584.00	0.07
547	002351	漫步者	32,100	376,212.00	0.07
548	600512	腾达建设	115,300	375,878.00	0.07
549	688182	灿勤科技	18,387	375,830.28	0.07
550	300477	合纵科技	46,600	375,130.00	0.07
551	000603	盛达资源	29,800	374,884.00	0.07
552	600103	青山纸业	132,900	374,778.00	0.07

553	300738	奥飞数据	16,480	374,096.00	0.07
554	000560	我爱我家	118,800	373,032.00	0.07
555	688568	中科星图	4,717	372,548.66	0.07
556	688366	昊海生科	2,955	372,004.95	0.07
557	300322	硕贝德	26,800	371,984.00	0.07
558	600503	华丽家族	115,500	371,910.00	0.07
559	300657	弘信电子	22,500	371,475.00	0.07
560	600810	神马股份	29,700	369,765.00	0.07
561	000823	超声电子	27,100	369,102.00	0.07
562	688100	威胜信息	10,720	369,089.60	0.07
563	601609	金田铜业	42,600	368,490.00	0.07
564	300078	思创医惠	49,900	368,262.00	0.07
565	300378	鼎捷软件	15,300	367,200.00	0.07
566	600557	康缘药业	29,900	365,976.00	0.07
567	600114	东睦股份	31,100	365,425.00	0.07
568	600308	华泰股份	58,900	364,591.00	0.07
569	688520	神州细胞	6,223	363,734.35	0.07
570	000903	云内动力	99,300	361,452.00	0.07
571	600933	爱柯迪	18,700	360,536.00	0.07
572	600502	安徽建工	86,800	360,220.00	0.07
573	002537	海联金汇	50,700	359,970.00	0.07
574	001696	宗申动力	49,500	359,865.00	0.07
575	300429	强力新材	29,700	359,370.00	0.07
576	300045	华力创通	30,900	359,367.00	0.07
577	002646	天佑德酒	17,000	356,830.00	0.07
578	688133	泰坦科技	1,635	356,757.00	0.07
579	002741	光华科技	16,900	354,562.00	0.07
580	002803	吉宏股份	16,700	354,541.00	0.07
581	600523	贵航股份	14,500	353,800.00	0.07
582	002913	奥士康	4,500	352,890.00	0.07
583	601929	吉视传媒	156,800	352,800.00	0.07
584	000592	平潭发展	111,400	352,024.00	0.07
585	300208	青岛中程	32,400	351,216.00	0.07
586	603025	大豪科技	13,300	350,987.00	0.07
587	300194	福安药业	68,500	350,720.00	0.07
588	600662	外服控股	48,900	350,124.00	0.07
589	300428	立中集团	13,300	349,790.00	0.07
590	300134	大富科技	27,600	348,864.00	0.07
591	002895	川恒股份	14,100	348,129.00	0.07
592	002737	葵花药业	21,100	347,306.00	0.07
593	600395	盘江股份	47,700	346,779.00	0.07
594	688399	硕世生物	2,514	345,675.00	0.07
595	000710	贝瑞基因	17,800	345,320.00	0.07
596	002285	世联行	87,900	344,568.00	0.07

597	002218	拓日新能	50,900	344,084.00	0.07
598	002516	旷达科技	53,000	343,970.00	0.07
599	000688	国城矿业	24,600	343,908.00	0.07
600	000851	高鸿股份	57,500	343,850.00	0.06
601	000088	盐田港	64,800	343,440.00	0.06
602	600581	八一钢铁	55,200	342,792.00	0.06
603	300397	天和防务	22,400	342,496.00	0.06
604	603920	世运电路	15,350	342,305.00	0.06
605	301035	润丰股份	5,900	342,200.00	0.06
606	603801	志邦家居	11,220	341,312.40	0.06
607	600326	西藏天路	52,900	341,205.00	0.06
608	002918	蒙娜丽莎	11,900	340,697.00	0.06
609	300792	壹网壹创	6,951	340,599.00	0.06
610	300653	正海生物	5,100	340,527.00	0.06
611	000989	九芝堂	31,300	339,918.00	0.06
612	600125	铁龙物流	65,800	339,528.00	0.06
613	300783	三只松鼠	8,700	339,039.00	0.06
613	601606	长城军工	26,100	339,039.00	0.06
615	002292	奥飞娱乐	53,200	336,756.00	0.06
616	300132	青松股份	29,700	335,313.00	0.06
617	603666	亿嘉和	4,460	335,035.20	0.06
618	300020	银江技术	37,800	334,530.00	0.06
619	603060	国检集团	17,320	334,276.00	0.06
620	603959	百利科技	21,200	334,112.00	0.06
621	603033	三维股份	12,900	333,594.00	0.06
622	300761	立华股份	8,800	332,728.00	0.06
623	002605	姚记科技	14,600	331,858.00	0.06
624	603466	风语筑	12,180	331,296.00	0.06
625	000881	中广核技	34,100	328,383.00	0.06
626	603118	共进股份	34,300	327,908.00	0.06
627	002545	东方铁塔	35,900	327,408.00	0.06
628	002232	启明信息	14,700	327,222.00	0.06
629	600604	市北高新	60,900	327,033.00	0.06
630	600331	宏达股份	102,500	326,975.00	0.06
631	600997	开滦股份	45,800	326,096.00	0.06
632	600480	凌云股份	32,900	326,039.00	0.06
633	300867	圣元环保	11,800	325,326.00	0.06
634	000036	华联控股	74,800	324,632.00	0.06
635	601827	三峰环境	36,300	323,796.00	0.06
636	000900	现代投资	76,500	322,830.00	0.06
637	002437	誉衡药业	110,900	322,719.00	0.06
638	002677	浙江美大	18,600	322,710.00	0.06
639	603533	掌阅科技	12,600	321,426.00	0.06
640	000652	泰达股份	74,400	320,664.00	0.06

641	300441	鲍斯股份	28,400	320,636.00	0.06
642	002891	中宠股份	10,600	320,544.00	0.06
643	300229	拓尔思	30,900	319,815.00	0.06
644	300366	创意信息	26,300	318,756.00	0.06
645	000910	大亚圣象	23,700	317,817.00	0.06
646	600098	广州发展	39,300	317,544.00	0.06
647	600876	洛阳玻璃	8,600	317,254.00	0.06
648	300311	任子行	38,800	316,996.00	0.06
649	002376	新北洋	33,600	316,848.00	0.06
650	002847	盐津铺子	3,700	316,720.00	0.06
651	601163	三角轮胎	23,100	316,701.00	0.06
652	002636	金安国纪	21,000	316,050.00	0.06
653	300145	中金环境	96,900	315,894.00	0.06
654	603387	基蛋生物	15,740	315,744.40	0.06
655	603363	傲农生物	24,700	313,690.00	0.06
656	300423	昇辉科技	21,600	313,416.00	0.06
657	002697	红旗连锁	58,800	312,816.00	0.06
658	000061	农产品	48,900	312,471.00	0.06
659	600715	文投控股	93,600	311,688.00	0.06
660	300006	莱美药业	45,700	311,674.00	0.06
661	002550	千红制药	64,526	311,660.58	0.06
662	300130	新国都	21,200	311,216.00	0.06
663	600017	日照港	110,700	311,067.00	0.06
664	002647	仁东控股	32,200	311,052.00	0.06
665	002035	华帝股份	48,900	311,004.00	0.06
666	300307	慈星股份	39,400	310,078.00	0.06
667	600284	浦东建设	48,900	309,048.00	0.06
668	000667	美好置业	177,600	309,024.00	0.06
669	300266	兴源环境	79,200	308,880.00	0.06
670	300616	尚品宅配	7,200	308,808.00	0.06
671	300292	吴通控股	77,300	308,427.00	0.06
672	603566	普莱柯	13,900	307,190.00	0.06
673	600590	泰豪科技	36,900	305,163.00	0.06
674	000828	东莞控股	29,900	304,382.00	0.06
675	688162	巨一科技	3,686	304,279.30	0.06
676	000006	深振业 A	68,000	303,280.00	0.06
677	300183	东软载波	16,634	303,237.82	0.06
678	603229	奥翔药业	8,320	302,931.20	0.06
679	000597	东北制药	48,600	302,292.00	0.06
680	600602	云赛智联	46,500	302,250.00	0.06
681	603313	梦百合	17,460	302,232.60	0.06
682	300829	金丹科技	6,600	301,620.00	0.06
683	000810	创维数字	30,600	301,410.00	0.06
684	300204	舒泰神	17,100	300,105.00	0.06

685	000507	珠海港	46,400	299,744.00	0.06
686	300723	一品红	8,340	299,406.00	0.06
687	603105	芯能科技	18,000	299,160.00	0.06
688	002589	瑞康医药	75,900	298,287.00	0.06
689	601330	绿色动力	28,500	297,540.00	0.06
690	002309	中利集团	43,900	296,764.00	0.06
691	002651	利君股份	22,400	296,352.00	0.06
692	600550	保变电气	53,000	296,270.00	0.06
693	300191	潜能恒信	11,500	296,240.00	0.06
694	002243	力合科创	26,200	295,798.00	0.06
695	300206	理邦仪器	21,000	295,680.00	0.06
696	002042	华孚时尚	64,600	295,222.00	0.06
697	300607	拓斯达	18,440	295,040.00	0.06
698	000566	海南海药	56,100	294,525.00	0.06
699	002573	清新环境	40,400	294,112.00	0.06
700	300439	美康生物	13,800	294,078.00	0.06
701	600846	同济科技	36,000	293,760.00	0.06
702	600184	光电股份	18,300	293,349.00	0.06
703	002017	东信和平	19,300	292,781.00	0.06
704	000697	炼石航空	33,900	292,218.00	0.06
705	000931	中关村	38,000	291,460.00	0.06
706	300205	天喻信息	21,700	290,346.00	0.05
707	002461	珠江啤酒	31,900	290,290.00	0.05
708	300552	万集科技	7,200	290,088.00	0.05
709	300284	苏交科	45,500	289,835.00	0.05
710	300047	天源迪科	36,800	289,248.00	0.05
711	002320	海峡股份	48,150	288,900.00	0.05
712	600694	大商股份	14,800	288,748.00	0.05
713	600775	南京熊猫	29,000	288,550.00	0.05
714	600337	美克家居	82,200	288,522.00	0.05
715	300842	帝科股份	3,600	288,000.00	0.05
716	002664	长鹰信质	14,500	287,825.00	0.05
717	300981	中红医疗	3,600	287,784.00	0.05
718	603877	太平鸟	10,300	287,164.00	0.05
719	603728	鸣志电器	12,100	286,891.00	0.05
720	300527	中船应急	27,700	286,418.00	0.05
721	601588	北辰实业	115,000	285,200.00	0.05
722	688095	福昕软件	2,064	284,852.64	0.05
723	688389	普门科技	12,339	283,797.00	0.05
724	300238	冠昊生物	15,300	283,509.00	0.05
725	002298	中电兴发	37,300	283,107.00	0.05
726	002979	雷赛智能	10,910	282,241.70	0.05
727	603693	江苏新能	9,900	281,754.00	0.05
728	300740	水羊股份	17,700	281,253.00	0.05

729	300455	康拓红外	25,800	280,446.00	0.05
730	002489	浙江永强	78,400	279,888.00	0.05
731	600855	航天长峰	16,100	279,818.00	0.05
732	600971	恒源煤电	43,300	279,718.00	0.05
733	300039	上海凯宝	45,200	278,432.00	0.05
734	300365	恒华科技	25,900	278,425.00	0.05
735	000913	钱江摩托	19,600	278,124.00	0.05
736	600783	鲁信创投	21,500	277,780.00	0.05
737	002522	浙江众成	39,100	277,610.00	0.05
738	002367	康力电梯	34,500	277,035.00	0.05
739	002061	浙江交科	49,600	276,768.00	0.05
740	603169	兰石重装	30,300	276,033.00	0.05
741	300368	汇金股份	26,800	275,236.00	0.05
742	600261	阳光照明	62,800	275,064.00	0.05
743	300510	金冠股份	41,800	274,626.00	0.05
744	688526	科前生物	9,973	274,556.69	0.05
745	300386	飞天诚信	15,000	274,350.00	0.05
746	300255	常山药业	33,700	273,981.00	0.05
747	300215	电科院	27,300	273,819.00	0.05
748	600335	国机汽车	31,500	273,420.00	0.05
749	300799	左江科技	2,900	272,600.00	0.05
750	603609	禾丰股份	26,600	272,384.00	0.05
751	300080	易成新能	46,700	271,794.00	0.05
752	603212	赛伍技术	8,700	270,831.00	0.05
753	000070	特发信息	41,600	270,400.00	0.05
754	300872	天阳科技	8,100	270,216.00	0.05
755	002515	金字火腿	49,300	270,164.00	0.05
756	600565	迪马股份	110,400	269,376.00	0.05
757	688127	蓝特光学	11,717	269,373.83	0.05
758	601515	东风股份	33,100	269,103.00	0.05
759	600748	上实发展	66,400	268,920.00	0.05
760	603529	爱玛科技	5,900	268,863.00	0.05
761	600575	淮河能源	112,000	268,800.00	0.05
762	300276	三丰智能	61,200	268,668.00	0.05
763	000791	甘肃电投	39,200	268,128.00	0.05
764	300846	首都在线	17,700	267,624.00	0.05
765	601158	重庆水务	41,600	266,656.00	0.05
766	002034	旺能环境	15,400	265,958.00	0.05
767	002194	武汉凡谷	24,500	265,580.00	0.05
768	300684	中石科技	12,100	265,474.00	0.05
769	002301	齐心集团	31,700	265,329.00	0.05
770	000557	西部创业	63,000	265,230.00	0.05
771	000882	华联股份	137,900	263,389.00	0.05
772	300579	数字认证	6,500	263,250.00	0.05

773	000813	德展健康	64,600	262,922.00	0.05
774	000600	建投能源	51,600	262,644.00	0.05
775	603610	麒盛科技	10,155	262,608.30	0.05
776	300349	金卡智能	21,700	261,485.00	0.05
777	000968	蓝焰控股	27,900	260,865.00	0.05
778	300016	北陆药业	28,400	260,712.00	0.05
779	002479	富春环保	43,600	258,984.00	0.05
780	002547	春兴精工	56,800	257,872.00	0.05
781	000958	东方能源	50,400	257,040.00	0.05
782	002987	京北方	8,160	256,387.20	0.05
783	000950	重药控股	50,200	256,020.00	0.05
784	002755	奥赛康	20,100	255,873.00	0.05
785	300910	瑞丰新材	3,200	255,520.00	0.05
786	000032	深桑达 A	12,300	255,102.00	0.05
787	002251	步步高	37,300	254,386.00	0.05
788	002768	国恩股份	9,800	253,428.00	0.05
789	300590	移为通信	8,780	253,303.00	0.05
790	002215	诺普信	39,500	252,010.00	0.05
791	002912	中新赛克	7,600	251,484.00	0.05
792	002717	岭南股份	72,800	251,160.00	0.05
793	601700	风范股份	40,800	250,920.00	0.05
794	600449	宁夏建材	20,700	249,021.00	0.05
795	002798	帝欧家居	16,700	248,329.00	0.05
796	600569	安阳钢铁	82,800	247,572.00	0.05
797	603595	东尼电子	6,700	247,431.00	0.05
798	600710	苏美达	37,700	246,558.00	0.05
799	000567	海德股份	13,800	246,330.00	0.05
800	300860	锋尚文化	2,900	245,804.00	0.05
801	300110	华仁药业	51,100	245,280.00	0.05
802	002978	安宁股份	5,800	245,224.00	0.05
803	002782	可立克	13,700	244,819.00	0.05
804	300664	鹏鹞环保	36,000	244,800.00	0.05
805	603730	岱美股份	10,450	243,694.00	0.05
806	300531	优博讯	11,900	243,117.00	0.05
807	000550	江铃汽车	14,900	243,019.00	0.05
808	603626	科森科技	20,100	243,009.00	0.05
809	601963	重庆银行	27,300	242,970.00	0.05
810	300448	浩云科技	34,500	242,880.00	0.05
811	002204	大连重工	55,700	242,295.00	0.05
812	300190	维尔利	39,400	240,340.00	0.05
813	000936	华西股份	38,300	240,141.00	0.05
814	600624	复旦复华	34,600	239,778.00	0.05
815	002695	煌上煌	14,700	239,757.00	0.05
816	000601	韶能股份	46,700	239,104.00	0.05

817	603416	信捷电气	5,000	238,050.00	0.04
818	300388	节能国祯	30,300	237,855.00	0.04
819	002267	陕天然气	32,100	236,577.00	0.04
820	002961	瑞达期货	9,600	236,544.00	0.04
821	600975	新五丰	34,800	236,292.00	0.04
822	300520	科大国创	12,300	235,176.00	0.04
823	002435	长江健康	44,600	235,042.00	0.04
824	300328	宜安科技	29,800	233,930.00	0.04
825	300318	博晖创新	23,600	233,876.00	0.04
826	600894	广日股份	31,000	233,740.00	0.04
827	002383	合众思壮	32,200	233,128.00	0.04
828	301029	怡合达	2,538	233,040.06	0.04
829	688268	华特气体	2,573	232,084.60	0.04
830	600032	浙江新能	15,000	231,900.00	0.04
831	002929	润建股份	6,400	231,296.00	0.04
832	002662	京威股份	54,100	230,466.00	0.04
833	002542	中化岩土	78,100	230,395.00	0.04
834	601949	中国出版	39,400	230,096.00	0.04
835	603328	依顿电子	28,700	229,600.00	0.04
836	603359	东珠生态	16,040	229,372.00	0.04
837	002277	友阿股份	70,300	229,178.00	0.04
838	002562	兄弟科技	45,900	229,041.00	0.04
839	601069	西部黄金	18,600	228,594.00	0.04
840	603636	南威软件	25,500	227,970.00	0.04
841	603337	杰克股份	9,700	227,465.00	0.04
842	603590	康辰药业	7,000	227,430.00	0.04
843	300831	派瑞股份	11,500	227,125.00	0.04
844	603222	济民医疗	12,300	226,320.00	0.04
845	002609	捷顺科技	23,200	226,200.00	0.04
846	300066	三川智慧	45,000	225,900.00	0.04
847	600510	黑牡丹	30,200	225,896.00	0.04
848	002344	海宁皮城	46,100	225,890.00	0.04
849	605388	均瑶健康	12,400	225,556.00	0.04
850	688788	科思科技	1,649	225,418.30	0.04
851	688318	财富趋势	1,479	225,103.80	0.04
852	605090	九丰能源	6,400	225,088.00	0.04
853	000761	本钢板材	53,500	224,700.00	0.04
854	002950	奥美医疗	13,700	223,995.00	0.04
855	300523	辰安科技	10,100	223,210.00	0.04
856	603378	亚士创能	8,645	222,435.85	0.04
857	300252	金信诺	24,900	222,108.00	0.04
858	002378	章源钨业	26,600	221,312.00	0.04
859	600874	创业环保	31,300	221,291.00	0.04
860	000796	凯撒旅业	28,900	220,507.00	0.04

861	603383	顶点软件	6,100	218,990.00	0.04
862	601886	江河集团	33,200	218,788.00	0.04
863	002596	海南瑞泽	57,800	217,906.00	0.04
864	002959	小熊电器	3,400	217,158.00	0.04
865	300302	同有科技	21,100	217,119.00	0.04
866	605199	葫芦娃	8,700	216,804.00	0.04
867	002234	民和股份	12,600	216,216.00	0.04
868	603258	电魂网络	7,200	216,000.00	0.04
869	002672	东江环保	29,326	215,839.36	0.04
870	688505	复旦张江	15,273	215,349.30	0.04
871	603299	苏盐井神	22,300	213,188.00	0.04
872	301031	中熔电气	1,400	212,968.00	0.04
873	600007	中国国贸	14,500	208,800.00	0.04
874	600636	国新文化	19,400	208,356.00	0.04
875	300548	博创科技	6,300	208,152.00	0.04
876	000498	山东路桥	33,600	207,648.00	0.04
877	600548	深高速	20,700	206,586.00	0.04
878	605339	南侨食品	6,200	206,584.00	0.04
879	002991	甘源食品	2,700	206,010.00	0.04
880	688020	方邦股份	2,246	204,722.90	0.04
881	300572	安车检测	9,900	204,435.00	0.04
882	003009	中天火箭	3,300	203,841.00	0.04
883	300856	科思股份	3,200	202,144.00	0.04
884	600800	渤海化学	42,700	201,971.00	0.04
885	688222	成都先导	8,591	201,802.59	0.04
886	002970	锐明技术	4,900	201,684.00	0.04
887	600618	氯碱化工	16,200	201,042.00	0.04
888	002582	好想你	23,100	200,970.00	0.04
889	300800	力合科技	6,900	199,962.00	0.04
890	600929	雪天盐业	26,800	199,928.00	0.04
891	603587	地素时尚	10,400	199,264.00	0.04
892	002303	美盈森	55,100	197,809.00	0.04
893	000639	西王食品	38,900	197,612.00	0.04
894	002993	奥海科技	5,000	196,900.00	0.04
895	000885	城发环境	18,500	196,100.00	0.04
896	000048	京基智农	11,300	195,603.00	0.04
897	002228	合兴包装	53,500	195,275.00	0.04
898	002641	公元股份	35,600	195,088.00	0.04
899	002838	道恩股份	11,800	193,520.00	0.04
900	000065	北方国际	22,300	191,334.00	0.04
901	002975	博杰股份	3,000	190,560.00	0.04
902	002990	盛视科技	5,500	189,805.00	0.04
903	603208	江山欧派	3,000	189,240.00	0.04
904	600622	光大嘉宝	64,800	189,216.00	0.04

905	300673	佩蒂股份	9,150	187,392.00	0.04
906	605009	豪悦护理	3,400	186,966.00	0.04
907	603439	贵州三力	11,800	186,204.00	0.04
908	002792	通宇通讯	11,600	185,600.00	0.04
909	605338	巴比食品	5,300	184,652.00	0.03
910	300815	玉禾田	6,000	183,480.00	0.03
910	002530	金财互联	27,800	183,480.00	0.03
912	300485	赛升药业	13,900	183,341.00	0.03
913	002314	南山控股	58,600	182,832.00	0.03
914	600916	中国黄金	13,300	182,609.00	0.03
915	603869	新智认知	18,200	182,364.00	0.03
916	603508	思维列控	7,900	181,542.00	0.03
917	688085	三友医疗	5,870	181,206.90	0.03
918	300765	新诺威	11,780	180,705.20	0.03
919	000544	中原环保	28,100	179,840.00	0.03
920	600054	黄山旅游	18,400	179,768.00	0.03
921	688086	紫晶存储	8,164	179,608.00	0.03
922	300785	值得买	2,500	179,350.00	0.03
923	603093	南华期货	13,200	179,256.00	0.03
924	688176	亚虹医药	7,779	178,761.42	0.03
925	600825	新华传媒	37,600	177,472.00	0.03
926	000011	深物业 A	15,200	177,232.00	0.03
927	300127	银河磁体	7,000	176,750.00	0.03
928	003040	楚天龙	6,700	176,344.00	0.03
929	300857	协创数据	5,900	170,864.00	0.03
930	300805	电声股份	12,200	170,312.00	0.03
931	688278	特宝生物	5,815	170,263.20	0.03
932	000025	特力 A	11,335	169,571.60	0.03
933	601921	浙版传媒	17,600	169,488.00	0.03
934	600996	贵广网络	30,300	168,771.00	0.03
935	603180	金牌厨柜	4,380	168,630.00	0.03
936	002941	新疆交建	13,900	168,051.00	0.03
937	300634	彩讯股份	9,600	166,368.00	0.03
938	000019	深粮控股	23,820	165,787.20	0.03
939	688055	龙腾光电	24,109	165,146.65	0.03
940	002793	罗欣药业	15,800	163,846.00	0.03
941	300791	仙乐健康	3,900	162,630.00	0.03
942	600686	金龙汽车	25,800	162,024.00	0.03
943	301039	中集车辆	12,592	161,365.92	0.03
944	002977	天箭科技	2,000	160,120.00	0.03
945	605222	起帆电缆	6,100	158,539.00	0.03
946	002880	卫光生物	4,900	157,682.00	0.03
947	603887	城地香江	19,400	157,528.00	0.03
948	603808	歌力思	10,700	156,113.00	0.03

949	300900	广联航空	4,500	154,575.00	0.03
950	003012	东鹏控股	11,200	153,664.00	0.03
951	688177	百奥泰	5,919	152,887.77	0.03
952	603283	赛腾股份	5,200	152,880.00	0.03
953	688030	山石网科	5,152	152,808.32	0.03
954	003039	顺控发展	4,900	152,047.00	0.03
955	601858	中国科传	17,000	149,940.00	0.03
956	002287	奇正藏药	4,900	149,744.00	0.03
957	002307	北新路桥	34,900	149,023.00	0.03
958	002955	鸿合科技	6,800	148,376.00	0.03
959	000797	中国武夷	56,600	147,726.00	0.03
960	000058	深赛格	21,400	144,022.00	0.03
961	300894	火星号	2,900	142,593.00	0.03
962	002982	湘佳股份	2,900	141,491.00	0.03
963	605136	丽人丽妆	5,800	141,230.00	0.03
964	601595	上海电影	12,900	139,578.00	0.03
965	600746	江苏索普	10,100	139,380.00	0.03
966	605008	长鸿高科	9,300	137,361.00	0.03
967	600738	丽尚国潮	22,300	135,584.00	0.03
968	601528	瑞丰银行	12,000	135,360.00	0.03
969	688001	华兴源创	3,768	135,158.16	0.03
970	002973	侨银股份	8,900	134,479.00	0.03
971	603053	成都燃气	12,800	132,992.00	0.03
972	002616	长青集团	21,400	130,112.00	0.02
973	000918	嘉凯城	52,000	129,480.00	0.02
974	300526	中潜股份	5,900	128,974.00	0.02
975	605296	神农集团	3,100	124,961.00	0.02
976	300788	中信出版	4,100	121,442.00	0.02
977	688365	光云科技	8,598	119,168.28	0.02
978	002969	嘉美包装	20,700	117,783.00	0.02
979	600248	陕西建工	24,300	116,640.00	0.02
980	000517	荣安地产	45,800	112,668.00	0.02
981	603171	税友股份	3,200	112,640.00	0.02
982	603976	正川股份	3,200	109,184.00	0.02
983	603815	交建股份	13,400	106,798.00	0.02
984	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.02
985	301015	百洋医药	3,403	103,110.90	0.02
986	605099	共创草坪	2,900	102,515.00	0.02
987	603327	福蓉科技	5,800	102,080.00	0.02
988	601686	友发集团	10,400	101,920.00	0.02
989	002911	佛燃能源	8,920	99,904.00	0.02
990	300942	易瑞生物	3,200	92,352.00	0.02
991	601279	英利汽车	11,800	89,562.00	0.02
992	002980	华盛昌	2,900	88,189.00	0.02

993	603013	亚普股份	5,200	86,944.00	0.02
994	603956	威派格	4,600	81,880.00	0.02
995	002989	中天精装	3,200	80,928.00	0.02
996	603511	爱慕股份	3,100	73,532.00	0.01
997	603103	横店影视	5,400	71,334.00	0.01
998	605007	五洲特纸	3,100	71,331.00	0.01
999	605365	立达信	3,600	69,012.00	0.01
1,000	603711	香飘飘	3,900	63,960.00	0.01
1,001	003006	百亚股份	3,400	60,962.00	0.01
1,002	003032	传智教育	2,900	60,900.00	0.01
1,003	603530	神马电力	3,100	59,489.00	0.01
1,004	605118	力鼎光电	3,200	53,120.00	0.01
1,005	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
1,006	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
1,007	301211	亨迪药业	575	19,348.75	0.00
1,008	301127	天源环保	963	16,486.56	0.00
1,009	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
1,010	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
1,011	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
1,012	300994	久祺股份	305	13,862.25	0.00
1,013	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
1,014	301017	漱玉平民	536	12,756.80	0.00
1,015	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
1,016	301179	泽宇智能	235	11,930.95	0.00
1,017	301020	密封科技	360	10,958.40	0.00
1,018	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
1,019	301026	浩通科技	168	10,538.64	0.00
1,020	301096	百诚医药	126	9,894.78	0.00
1,021	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
1,022	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
1,023	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
1,024	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
1,025	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
1,026	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
1,027	301108	洁雅股份	146	7,841.66	0.00
1,028	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
1,029	301028	东亚机械	573	7,735.50	0.00
1,030	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
1,031	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
1,032	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
1,033	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
1,034	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
1,035	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
1,036	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00

1,037	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
1,038	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
1,039	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
1,040	301049	超越科技	181	5,958.52	0.00
1,041	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
1,042	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
1,043	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
1,044	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
1,045	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
1,046	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
1,047	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
1,048	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
1,049	301036	双乐股份	144	4,309.92	0.00
1,050	301027	华蓝集团	250	4,162.50	0.00
1,051	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
1,052	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
1,053	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688116	天奈科技	8,129,766.77	1.54
2	603026	石大胜华	6,632,424.33	1.25
3	603185	上机数控	5,758,788.00	1.09
4	603236	移远通信	5,746,931.66	1.09
5	688388	嘉元科技	5,651,725.08	1.07
6	688005	容百科技	5,454,939.26	1.03
7	688122	西部超导	5,238,536.22	0.99
8	603678	火炬电子	4,829,850.00	0.91
9	600499	科达制造	4,771,655.00	0.90
10	601058	赛轮轮胎	4,647,322.60	0.88
11	600711	盛屯矿业	4,369,641.00	0.83
12	603127	昭衍新药	4,198,792.96	0.79
13	600882	妙可蓝多	4,041,376.00	0.76
14	600110	诺德股份	4,031,906.00	0.76
15	603267	鸿远电子	3,938,700.10	0.74
16	603613	国联股份	3,603,267.81	0.68
17	603345	安井食品	3,577,386.00	0.68
18	600559	老白干酒	3,371,804.10	0.64
19	601677	明泰铝业	3,341,245.82	0.63

20	603456	九洲药业	3,207,073.50	0.61
----	--------	------	--------------	------

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688116	天奈科技	6,366,279.96	1.20
2	688005	容百科技	5,839,047.63	1.10
3	603185	上机数控	5,671,277.50	1.07
4	688388	嘉元科技	4,656,476.20	0.88
5	603236	移远通信	4,467,979.32	0.84
6	603267	鸿远电子	4,250,351.54	0.80
7	603127	昭衍新药	4,183,002.20	0.79
8	603026	石大胜华	4,038,445.99	0.76
9	603613	国联股份	3,718,618.05	0.70
10	688122	西部超导	3,707,727.87	0.70
11	603456	九洲药业	3,682,863.46	0.70
12	603345	安井食品	3,559,085.00	0.67
13	300751	迈为股份	3,529,405.00	0.67
14	603678	火炬电子	3,478,285.00	0.66
15	601058	赛轮轮胎	3,155,194.00	0.60
16	600499	科达制造	3,120,350.54	0.59
17	600882	妙可蓝多	2,877,265.00	0.54
18	600711	盛屯矿业	2,683,036.00	0.51
19	300763	锦浪科技	2,481,793.00	0.47
20	600110	诺德股份	2,349,549.00	0.44

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	801,374,808.88
卖出股票收入（成交）总额	450,660,084.82

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	40,103.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,103.20	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	127052	杭锅转债	184	18,400.00	0.00
2	123133	佩蒂转债	155	15,500.00	0.00
3	111002	特纸转债	40	6,203.20	0.00
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，盛新锂能集团股份有限公司、江西特种电机股份有限公司、光启技术股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门立案调查、公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，盛新锂能、江特电机、光启技术系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	67,583.97
2	应收证券清算款	71,583.95
3	应收股利	-
4	应收利息	995.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,163.47

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
5,342	117,750.33	495,791,471.00	78.82%	133,230,807.00	21.18%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中信证券股份有限公司	121,761,302.00	19.36%
2	华泰证券股份有限公司融券专用证券 账户	99,750,000.00	15.86%
3	中信建投证券股份有限公司	88,153,220.00	14.01%
4	广发证券股份有限公司	43,786,469.00	6.96%
5	浙商期货—浙商证券股份有限公司— 浙商期货融畅 1 号单一资产管理计划	37,492,600.00	5.96%
6	中信证券股份有限公司融券专用证券 账户	25,906,800.00	4.12%
7	申万宏源证券有限公司	13,543,933.00	2.15%
8	中国国际金融股份有限公司	12,180,177.00	1.94%
9	国盛证券有限责任公司	10,388,162.00	1.65%
10	颜飞	9,081,821.00	1.44%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021 年 3 月 18 日)基金份额总额	228,866,784.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,300,800,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,032,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	131,355,494.00

本报告期末基金份额总额	629,022,278.00
-------------	----------------

注：本基金合同于2021年3月18日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布公告，蔡向阳先生不再担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内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	10	725,295,579.37	58.30%	264,069.50	59.63%	-
中金公司	4	251,927,041.58	20.25%	63,713.60	14.39%	-
中泰证券	1	130,745,706.42	10.51%	56,391.67	12.73%	-

方正证券	1	82,123,074.03	6.60%	35,426.40	8.00%	-
中信建投证券	3	25,889,371.75	2.08%	11,168.47	2.52%	-
华泰证券	2	23,930,900.87	1.92%	10,321.73	2.33%	-
西部证券	1	4,076,674.34	0.33%	1,758.30	0.40%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于2021年3月18日生效，除本表列示外，本基金还选择了东吴证券、光大证券、国联证券、国泰君安证券、华西证券、江海证券、金元证券、联储证券、平安证券、申万宏源证券、招商证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

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	
	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
中信证券	54,807.20	15.90%	-	-
中金公司	-	-	-	-
中泰证券	228,423.16	66.27%	-	-
方正证券	-	-	35,000,000.00	100.00%
中信建投证券	-	-	-	-
华泰证券	61,461.24	17.83%	-	-
西部证券	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-19
2	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-19
3	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-24
4	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
5	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
6	华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
7	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
8	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
9	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
14	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
15	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
17	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-28

18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-08
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
22	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-03
28	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-12
29	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-14
30	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-07
31	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-14
32	华夏基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-21
33	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-30
34	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-13
35	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
36	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-20
37	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
38	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-23

39	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-02
40	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-10
41	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-22
42	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-04
43	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-08
44	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-10

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-04-06	40,000,777.00	92,488,129.00	131,253,504.00	1,235,402.00	0.20%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日