

华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 08 月 29 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未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68

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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末上市基金前十名持有人	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数证券投资基金
基金简称	华宝中证 1000 指数
场内简称	中证 1000 基金
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	2020 年 11 月 19 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	36,017,103.47 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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率 \times 95% + 同期银行活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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	021-60637111
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 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	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、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、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

§ 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,110,377.61
本期利润	-8,236,100.59
加权平均基金份额本期利润	-0.2080
本期加权平均净值利润率	-20.26%
本期基金份额净值增长率	-11.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-62,983,824.28
期末可供分配基金份额利润	-1.7487
期末基金资产净值	38,083,008.72
期末基金份额净值	1.0574
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.19%

注：1. 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 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。

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

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

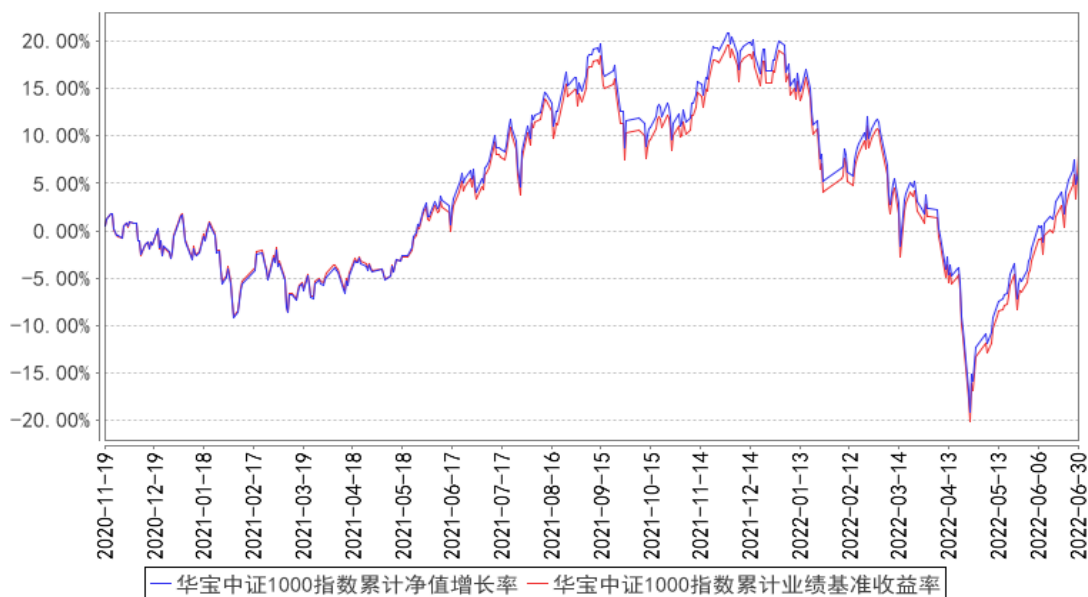
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.65%	1.23%	9.59%	1.24%	0.06%	-0.01%
过去三个月	3.78%	1.93%	3.20%	1.95%	0.58%	-0.02%
过去六个月	-11.50%	1.76%	-11.98%	1.78%	0.48%	-0.02%
过去一年	-0.33%	1.48%	-1.02%	1.51%	0.69%	-0.03%
自基金合同生效起至今	6.19%	1.34%	4.68%	1.36%	1.51%	-0.02%

注：（1）基金业绩基准：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%；

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

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

华宝中证1000指数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：按照基金合同的约定，基金管理人应当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基金合同的有关约定，截至 2021 年 05 月 19 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2022 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：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、华宝可转债债券型证券投资基金、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、华宝创新优选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、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、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、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金等, 共 128 只基金。

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		
丰晨成	本基金基金经理	2020-11-19	-	13 年	硕士。2009 年 7 月加入华宝基金管理有限公司, 先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 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 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理, 2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理, 2022 年 2 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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、《华宝中证 1000 指数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

2022 年上半年，在百年未有之大变局的时代背景下，地缘政治动荡叠加突发因素的干扰，在众多外部黑天鹅事件下，A 股经历了先跌后涨的独立行情，整体波动明显加剧。受俄乌战争的影响，以油价为代表的能源价格居于高位引发全球各国通胀压力，美股加息预期增强，美元强势，引发资金从新兴市场回流；国内部分城市运行、企业开工和物流受到突发因素影响较大，引发对宏观经济增速下修的预期，对投资者的短期风险偏好形成压制，国内以创业板为代表的成长板块

从一月到四月明显走弱，尤其是投资者的悲观情绪一度引发了 4 月下旬加速探底，上证指数一度跌破 3000 点，随着中央稳住经济大盘“保持经济运行在合理区间，力争实现最好结果”的定调以及稳增长政策措施的密集落地，内外部因素好转使得五六月份市场逐渐走出一波明显的反弹走势，在经济增长企稳修复的预期下，以新能源汽车为代表的成长股在反弹中领涨，北向资金也阶段性恢复大幅度流入。经济缓慢复苏加上流动性宽松呵护的状态，企业盈利触底回升，有利于权益资产定价，作为 A 股市场小盘股的典型代表，中证 1000 指数从 4 月底开始跟随市场风险偏好的转暖而逐步反弹。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持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-11.50%，业绩比较基准收益率为-11.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年总体看国内经济的复苏势头仍将持续，不断改进的防控措施有望淡化对经济的短期冲击，合理充裕的货币供应预期，积极的稳增长政策的密集出台，市场信心将得到恢复，在“保交楼、稳民生”的要求下，地产产业链信用环境的改善有望提振基建稳增长力度，一系列保就业稳经济的产业政策的落地，实体经济信用环境的逐渐改善。历史上看，小盘风格往往具有高弹性的特征，在经济开始复苏、盈利预期触底、市场流动性预期较为充裕的时候，市场风险偏好提升，小盘股的上涨势头往往都是比大盘股猛的。截止报告期末中证 1000 指数的 PE-TTM 估值在 30X 左右，以历史数据看位于 11%分位点左右的位置。

从国内外市场来看，大小盘作为市场的主要风格，存在非常明显的轮动效应。从过去 10 年的历史回顾看，大盘股和中小盘股的相对强弱是以四年左右的时间呈现出周期律的强弱势变化，以 2021 年 2 月为界，抱团投资达到了一个历史极值，大盘风格“抱团股散”重新切换到了小盘风格占优。今年的情况是，在复苏的过程中、保就业的背景下，尤其需要对中小企业尤其是制造业的扶持；多层次资本市场的建设、北交所的设立、全面注册制渐行渐近，也是对中小企业融资支持的题中之意。只要经济复苏中，宏观流动性依然呵护，政策的倾斜叠加流动性的宽松，在这个时点我们对以中证 1000 指数为代表的小市值风格抱有乐观判断。

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及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

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

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或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

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

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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 指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,338,826.27	3,800,753.80
结算备付金		-	-
存出保证金		9,620.08	2,607.64
交易性金融资产	6.4.7.2	36,072,616.00	50,537,217.70
其中：股票投资		36,072,616.00	50,537,217.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	135,171.17

应收股利		-	-
应收申购款		20,644.01	32,474.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	391.78
资产总计		38,441,706.36	54,508,616.27
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		124.80	-
应付赎回款		68,974.24	585,600.26
应付管理人报酬		15,033.76	22,632.13
应付托管费		3,006.77	4,526.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	271,558.07	196,151.09
负债合计		358,697.64	808,909.88
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	86,077,683.35	107,408,959.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-47,994,674.63	-53,709,252.90
净资产合计		38,083,008.72	53,699,706.39
负债和净资产总计		38,441,706.36	54,508,616.27

注：1. 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0574 元，基金份额总额 36,017,103.47 份。

2. 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,957,943.15	3,050,444.74
1. 利息收入		5,893.83	4,506.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,893.83	4,506.35
债券利息收入		-	-
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）		-2,861,636.98	-26,966.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,117,578.79	-270,899.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	255,941.81	243,933.03
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-5,125,722.98	3,066,539.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	23,522.98	6,365.24
减：二、营业总支出		278,157.44	274,747.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	100,825.17	92,309.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,165.05	18,462.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	6.4.7.23	157,167.22	163,975.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,236,100.59	2,775,696.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,236,100.59	2,775,696.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,236,100.59	2,775,696.86

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,331,275.94	-	5,714,578.27	-15,616,697.67
（一）、综合收益总	-	-	-8,236,100.59	-8,236,100.59

额				
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-21,331,275.94	-	13,950,678.86	-7,380,597.08
其中: 1. 基金申购款	54,581,305.33	-	-32,331,932.30	22,249,373.03
2. 基金赎回款	-75,912,581.27	-	46,282,611.16	-29,629,970.11
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	86,077,683.35	-	-47,994,674.63	38,083,008.72
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	92,794,990.81	-	-54,358,984.67	38,436,006.14
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期期 初净 资产 (基 金 净 值)	92,794,990.81	-	-54,358,984.67	38,436,006.14
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	-1,882,420.62	-	3,802,281.11	1,919,860.49
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	2,775,696.86	2,775,696.86
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	-1,882,420.62	-	1,026,584.25	-855,836.37
其中：1. 基 金 申 购 款	19,621,509.34	-	-11,713,864.71	7,907,644.63
2. 基 金 赎 回 款	-21,503,929.96	-	12,740,448.96	-8,763,481.00
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留 存 收 益	-	-	-	-
四、本 期 期 末 净 资	90,912,570.19	-	-50,556,703.56	40,355,866.63

产（基金 净值）				
-------------	--	--	--	--

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：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
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 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），原华宝中证 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），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。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。

2020 年 10 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型为华宝中证 1000 指数证券投资基金，取消分级运作机制，基金名称相应变更为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”并修订《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》。上述基金转型事项已于 2020 年 10 月 19 日经持有人大会表决通过生效，自 2020 年 11 月 19 日起，《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效，《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。本基金为契约型开放式基金，

存续期限不定。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。

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、存托凭证和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（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、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、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）。本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与融资融券出借等相关业务。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：本基金投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产净值的 90%，且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×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表已于 2022 年 8 月 31 日经本基金的基金管理人批准。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第

二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产

款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,800,753.80 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 390.27 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,801,144.07 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,607.64 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1.32 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,608.96 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 32,474.18 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.19 元，重新计量金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 32,474.37 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 391.78 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 390.27 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1.32 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.19 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息在新金融工具准则下不再单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。(4) 企业所得税 根据财政部、国家

税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。（5）个人所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,338,826.27
等于：本金	2,338,606.29
加：应计利息	219.98
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,338,826.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	35,136,814.51	-	36,072,616.00	935,801.49
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	35,136,814.51	-	36,072,616.00	935,801.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	168.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	64,262.67
其中：交易所市场	64,262.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,127.22
应付指数使用费	150,000.00
合计	271,558.07

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,943,274.25	107,408,959.29
本期申购	22,838,201.20	54,581,305.33
本期赎回（以“-”号填列）	-31,764,371.98	-75,912,581.27
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	36,017,103.47	86,077,683.35
-----	---------------	---------------

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 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
本期期初	-74,658,360.33	20,949,107.43	-53,709,252.90
本期利润	-3,110,377.61	-5,125,722.98	-8,236,100.59
本期基金份额交易产生的变动数	14,784,913.66	-834,234.80	13,950,678.86
其中：基金申购款	-38,249,078.63	5,917,146.33	-32,331,932.30
基金赎回款	53,033,992.29	-6,751,381.13	46,282,611.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-62,983,824.28	14,989,149.65	-47,994,674.63

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	5,583.05
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	266.82
其他	43.96
合计	5,893.83

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	26,100,146.22
减：卖出股票成本总额	29,144,906.94
减：交易费用	72,818.07
买卖股票差价收入	-3,117,578.79

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16 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。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	255,941.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	255,941.81

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,125,722.98
股票投资	-5,125,722.98
债券投资	-
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	-5,125,722.98

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	23,522.98
合计	23,522.98

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	17,455.64
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	40.00
指数使用费	100,000.00
合计	157,167.22

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，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要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

2022 年 4 月 25 日，中国证监会核准华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）将持有的华宝基金管理有限公司 20%股权转让给江苏省铁路集团。2022 年 5 月 24 日股权变更完成之后，华宝基金管理有限公司控股股东仍为华宝信托（持股 51%），华平投资（29%）、江苏省铁路集团（20%）分列第二、第三大股东。

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
江苏省铁路集团有限公司（“江苏铁集”）	基金管理人的股东
宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	100,825.17	92,309.99
其中：支付销售机构的客户维护费	40,949.61	36,336.78

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,165.05	18,462.03

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,338,826.27	5,583.05	2,787,182.82	4,379.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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(2022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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
000881	中广核技	2022年6月28日	重大事项停牌	9.02	2022年07月01日	9.56	2,600	33,577.99	23,452.00	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场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

本基金本报告期末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

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 1000 指数。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“以实现与跟踪指数相同”的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是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大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

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约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 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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上市公司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 2022 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	2,338,826.27	-	-	-	2,338,826.27
存出保证金	9,620.08	-	-	-	9,620.08
交易性金融资产	-	-	-	36,072,616.00	36,072,616.00
应收申购款	50.06	-	-	20,593.95	20,644.01
资产总计	2,348,496.41	-	-	36,093,209.95	38,441,706.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	68,974.24	68,974.24
应付管理人报酬	-	-	-	15,033.76	15,033.76
应付托管费	-	-	-	3,006.77	3,006.77
应付清算款	-	-	-	124.80	124.80
其他负债	-	-	-	271,558.07	271,558.07
负债总计	-	-	-	358,697.64	358,697.64
利率敏感度缺口	2,348,496.41	-	-	35,734,512.31	38,083,008.72
上年度末 2021 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	3,800,753.80	-	-	-	3,800,753.80
存出保证金	2,607.64	-	-	-	2,607.64
交易性金融资产	-	-	-	50,537,217.70	50,537,217.70
应收申购款	1,153.90	-	-	31,320.28	32,474.18
应收证券清算款	-	-	-	135,171.17	135,171.17
其他资产	-	-	-	391.78	391.78
资产总计	3,804,515.34	-	-	50,704,100.93	54,508,616.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	585,600.26	585,600.26
应付管理人报酬	-	-	-	22,632.13	22,632.13

应付托管费	-	-	-	4,526.40	4,526.40
其他负债	-	-	-	196,151.09	196,151.09
负债总计	-	-	-	808,909.88	808,909.88
利率敏感度缺口	3,804,515.34	-	-	49,895,191.05	53,699,706.39

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	36,072,616.00	94.72	50,537,217.70	94.11

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	36,072,616.00	94.72	50,537,217.70	94.11

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		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
1. 业绩比较基准上升 5%	1,869,451.18	2,633,242.18	
2. 业绩比较基准下降 5%	-1,869,451.18	-2,633,242.18	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	36,049,164.00	50,486,370.50
第二层次	23,452.00	50,847.20
第三层次	-	-

合计	36,072,616.00	50,537,217.70
----	---------------	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	36,072,616.00	93.84
	其中：股票	36,072,616.00	93.84
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	2,338,826.27	6.08
8	其他各项资产	30,264.09	0.08
9	合计	38,441,706.36	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	227,190.60	0.60
B	采矿业	1,244,646.54	3.27
C	制造业	25,569,090.02	67.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	960,046.24	2.52
E	建筑业	664,839.22	1.75
F	批发和零售业	941,486.40	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	624,495.27	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,922,236.80	7.67
J	金融业	737,027.00	1.94
K	房地产业	662,972.40	1.74
L	租赁和商务服务业	214,858.11	0.56
M	科学研究和技术服务业	423,695.74	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	434,640.28	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,915.00	0.03
Q	卫生和社会工作	118,866.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	253,280.00	0.67
S	综合	37,625.00	0.10
	合计	36,049,910.62	94.66

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	22,705.38	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
	合计	22,705.38	0.06

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	002176	江特电机	9,200	230,368.00	0.60
2	002405	四维图新	13,100	197,417.00	0.52
3	300568	星源材质	6,388	185,507.52	0.49
4	002738	中矿资源	1,960	181,515.60	0.48
5	603606	东方电缆	2,300	176,180.00	0.46
6	688116	天奈科技	1,000	169,480.00	0.45
7	002192	融捷股份	1,100	169,070.00	0.44
8	688063	派能科技	500	156,100.00	0.41
9	600873	梅花生物	13,500	152,280.00	0.40
10	000683	远兴能源	13,840	145,458.40	0.38
11	002312	川发龙蟒	7,800	134,628.00	0.35

12	002850	科达利	800	127,200.00	0.33
13	601677	明泰铝业	5,300	126,140.00	0.33
14	000762	西藏矿业	2,200	123,046.00	0.32
15	002432	九安医疗	2,000	120,120.00	0.32
16	603688	石英股份	900	119,349.00	0.31
17	300118	东方日升	3,900	114,387.00	0.30
18	000933	神火股份	8,600	112,488.00	0.30
19	600559	老白干酒	3,805	109,165.45	0.29
20	002472	双环传动	3,400	108,256.00	0.28
21	600872	中炬高新	3,100	107,291.00	0.28
22	002245	蔚蓝锂芯	4,600	106,766.00	0.28
23	002463	沪电股份	7,200	106,272.00	0.28
24	002025	航天电器	1,500	104,730.00	0.28
25	002610	爱康科技	24,900	103,086.00	0.27
26	300438	鹏辉能源	1,650	101,392.50	0.27
27	300395	菲利华	2,250	101,250.00	0.27
28	605111	新洁能	800	100,648.00	0.26
29	300373	扬杰科技	1,400	99,750.00	0.26
30	000422	湖北宜化	4,900	99,519.00	0.26
31	000818	航锦科技	2,900	98,310.00	0.26
32	600596	新安股份	4,540	98,291.00	0.26
33	000591	太阳能	11,660	97,361.00	0.26
34	002402	和而泰	5,050	96,253.00	0.25
35	000423	东阿阿胶	2,600	96,070.00	0.25
36	688202	美迪西	280	95,090.80	0.25
37	600456	宝钛股份	1,600	95,040.00	0.25
38	600771	广誉远	2,700	94,905.00	0.25
39	600711	盛屯矿业	12,200	94,672.00	0.25
40	688301	奕瑞科技	200	94,608.00	0.25
41	002436	兴森科技	8,300	93,541.00	0.25
42	300035	中科电气	3,300	92,235.00	0.24
43	603236	移远通信	686	91,690.76	0.24
44	300343	联创股份	6,000	91,140.00	0.24
45	002036	联创电子	5,923	90,977.28	0.24
46	600110	诺德股份	7,700	89,474.00	0.23
47	300604	长川科技	1,980	89,397.00	0.23
48	300432	富临精工	4,050	89,100.00	0.23
49	600338	西藏珠峰	3,100	88,970.00	0.23
50	300346	南大光电	2,470	88,870.60	0.23
51	000155	川能动力	4,000	88,600.00	0.23
52	601099	太平洋	29,600	88,504.00	0.23
53	300776	帝尔激光	512	88,473.60	0.23

54	688598	金博股份	300	88,410.00	0.23
55	601666	平煤股份	6,500	88,335.00	0.23
56	603596	伯特利	1,100	88,198.00	0.23
57	002044	美年健康	15,600	86,892.00	0.23
58	300725	药石科技	876	86,715.24	0.23
59	300458	全志科技	2,861	86,087.49	0.23
60	002456	欧菲光	12,800	85,888.00	0.23
61	603005	晶方科技	2,976	84,488.64	0.22
62	300339	润和软件	4,600	82,570.00	0.22
63	300803	指南针	1,400	82,292.00	0.22
64	002531	天顺风能	4,980	82,120.20	0.22
65	300393	中来股份	4,827	82,059.00	0.22
66	300775	三角防务	1,700	81,855.00	0.21
67	601001	晋控煤业	4,500	79,875.00	0.21
68	600882	妙可蓝多	1,700	79,560.00	0.21
69	300083	创世纪	6,900	79,350.00	0.21
70	002597	金禾实业	1,800	77,994.00	0.20
71	000860	顺鑫农业	2,900	77,778.00	0.20
72	688139	海尔生物	1,063	77,418.29	0.20
73	300054	鼎龙股份	3,640	77,058.80	0.20
74	688388	嘉元科技	900	76,383.00	0.20
75	600481	双良节能	4,500	75,825.00	0.20
76	300850	新强联	850	75,675.50	0.20
77	600777	新潮能源	28,300	75,561.00	0.20
78	300655	晶瑞电材	3,900	75,270.00	0.20
79	300068	南都电源	4,900	75,166.00	0.20
80	002487	大金重工	1,800	75,114.00	0.20
81	000875	吉电股份	10,700	74,365.00	0.20
82	300748	金力永磁	2,020	74,336.00	0.20
83	600179	安通控股	19,400	74,108.00	0.19
84	300327	中颖电子	1,460	72,722.60	0.19
85	300679	电连技术	1,645	72,692.55	0.19
86	603678	火炬电子	1,550	72,555.50	0.19
87	300777	中简科技	1,500	72,300.00	0.19
88	002558	巨人网络	7,900	72,285.00	0.19
89	000893	亚钾国际	2,100	72,261.00	0.19
90	300502	新易盛	2,725	71,395.00	0.19
91	002145	中核钛白	10,005	71,335.65	0.19
92	688200	华峰测控	200	71,280.00	0.19
93	002747	埃斯顿	2,900	71,050.00	0.19
94	300034	钢研高纳	1,679	70,820.22	0.19
95	002585	双星新材	3,890	70,370.10	0.18

96	002617	露笑科技	6,199	70,234.67	0.18
97	600416	湘电股份	3,700	70,152.00	0.18
98	603713	密尔克卫	500	68,350.00	0.18
99	002139	拓邦股份	5,525	67,791.75	0.18
100	688050	爱博医疗	300	67,260.00	0.18
101	601222	林洋能源	8,008	66,866.80	0.18
102	300409	道氏技术	2,560	66,508.80	0.17
103	300593	新雷能	1,600	66,416.00	0.17
104	603063	禾望电气	1,700	65,365.00	0.17
105	002706	良信股份	3,950	65,293.50	0.17
106	002541	鸿路钢构	1,950	65,130.00	0.17
107	601908	京运通	8,100	64,962.00	0.17
108	300861	美畅股份	700	64,883.00	0.17
109	002643	万润股份	3,100	64,666.00	0.17
110	600206	有研新材	3,300	63,822.00	0.17
111	600328	中盐化工	2,700	63,585.00	0.17
112	002484	江海股份	2,716	63,391.44	0.17
113	603876	鼎胜新材	1,400	63,280.00	0.17
114	601258	庞大集团	45,500	63,245.00	0.17
115	600641	万业企业	3,240	63,180.00	0.17
116	300077	国民技术	3,400	63,172.00	0.17
117	002151	北斗星通	2,000	63,120.00	0.17
118	300294	博雅生物	1,750	62,912.50	0.17
119	688083	中望软件	300	62,826.00	0.16
120	002182	云海金属	2,500	62,700.00	0.16
121	600151	航天机电	5,600	62,216.00	0.16
122	688696	极米科技	200	61,574.00	0.16
123	000902	新洋丰	3,600	60,804.00	0.16
124	002318	久立特材	3,800	60,762.00	0.16
125	002389	航天彩虹	3,300	60,588.00	0.16
126	600483	福能股份	4,300	60,501.00	0.16
127	300457	赢合科技	2,125	60,371.25	0.16
128	300623	捷捷微电	2,430	60,264.00	0.16
129	600273	嘉化能源	5,500	59,730.00	0.16
130	688019	安集科技	280	59,617.60	0.16
131	688680	海优新材	300	59,610.00	0.16
132	600277	亿利洁能	11,920	59,600.00	0.16
133	600123	兰花科创	3,600	59,220.00	0.16
134	603599	广信股份	2,100	59,115.00	0.16
135	603906	龙蟠科技	1,600	59,104.00	0.16
136	600295	鄂尔多斯	3,220	58,121.00	0.15
137	300682	朗新科技	2,300	57,937.00	0.15

138	600100	同方股份	13,000	57,850.00	0.15
139	600378	昊华科技	1,500	57,780.00	0.15
140	300671	富满微	800	57,648.00	0.15
141	002258	利尔化学	2,420	57,160.40	0.15
142	603588	高能环境	4,932	56,865.96	0.15
143	603129	春风动力	500	56,860.00	0.15
144	600063	皖维高新	7,500	56,850.00	0.15
145	002091	江苏国泰	5,260	56,545.00	0.15
146	002851	麦格米特	2,150	56,459.00	0.15
147	600055	万东医疗	2,300	55,959.00	0.15
148	601375	中原证券	13,400	55,878.00	0.15
149	603338	浙江鼎力	1,100	55,770.00	0.15
150	002761	浙江建投	1,800	55,566.00	0.15
151	601777	力帆科技	10,000	55,500.00	0.15
152	600323	瀚蓝环境	2,700	55,350.00	0.15
153	688066	航天宏图	700	55,160.00	0.14
154	601678	滨化股份	9,200	55,108.00	0.14
155	603008	喜临门	1,500	55,050.00	0.14
156	688608	恒玄科技	400	55,040.00	0.14
157	300487	蓝晓科技	900	54,900.00	0.14
157	300666	江丰电子	900	54,900.00	0.14
158	688333	铂力特	300	54,819.00	0.14
159	002807	江阴银行	12,100	54,813.00	0.14
160	000982	中银绒业	24,500	54,635.00	0.14
161	603027	千禾味业	3,149	54,477.70	0.14
162	300476	胜宏科技	2,920	53,611.20	0.14
163	600330	天通股份	4,480	53,356.80	0.14
164	600773	西藏城投	2,700	53,190.00	0.14
165	600057	厦门象屿	6,026	52,968.54	0.14
166	300298	三诺生物	1,880	52,828.00	0.14
167	605376	博迁新材	900	52,470.00	0.14
168	002544	普天科技	2,300	52,325.00	0.14
169	601567	三星医疗	3,900	51,792.00	0.14
170	688686	奥普特	200	51,730.00	0.14
171	300101	振芯科技	2,500	51,600.00	0.14
172	300613	富瀚微	608	51,558.40	0.14
173	000035	中国天楹	9,800	51,450.00	0.14
174	600583	海油工程	12,300	51,045.00	0.13
175	600246	万通发展	5,600	50,960.00	0.13
176	300171	东富龙	1,500	50,865.00	0.13
177	002839	张家港行	9,600	50,784.00	0.13
177	300459	汤姆猫	13,800	50,784.00	0.13

178	002126	银轮股份	4,400	50,380.00	0.13
179	603565	中谷物流	3,168	50,276.16	0.13
180	300767	震安科技	864	50,267.52	0.13
181	601231	环旭电子	3,500	50,260.00	0.13
182	603612	索通发展	1,360	50,116.00	0.13
183	688017	绿的谐波	420	49,980.00	0.13
184	002906	华阳集团	1,100	49,841.00	0.13
185	300185	通裕重工	17,300	49,651.00	0.13
186	300685	艾德生物	1,548	49,536.00	0.13
187	002291	星期六	2,500	49,400.00	0.13
188	600577	精达股份	8,900	49,395.00	0.13
189	600366	宁波韵升	3,900	49,140.00	0.13
190	300672	国科微	600	49,056.00	0.13
191	300587	天铁股份	2,400	49,032.00	0.13
192	601399	国机重装	15,100	48,924.00	0.13
193	300627	华测导航	1,420	48,833.80	0.13
194	000810	创维数字	3,000	48,630.00	0.13
195	002675	东诚药业	3,600	48,600.00	0.13
196	600389	江山股份	800	48,584.00	0.13
197	688356	键凯科技	200	48,362.00	0.13
198	603690	至纯科技	1,200	48,360.00	0.13
199	600129	太极集团	2,200	48,334.00	0.13
200	600977	中国电影	4,200	48,300.00	0.13
201	000546	金圆股份	3,000	48,180.00	0.13
202	002216	三全食品	2,450	47,995.50	0.13
203	002539	云图控股	3,000	47,970.00	0.13
204	688298	东方生物	420	47,943.00	0.13
205	002015	协鑫能科	2,700	47,898.00	0.13
206	603279	景津装备	1,540	47,755.40	0.13
207	000829	天音控股	4,000	47,640.00	0.13
208	603179	新泉股份	1,640	47,560.00	0.12
209	300567	精测电子	1,100	47,520.00	0.12
210	300747	锐科激光	1,212	47,146.80	0.12
211	600172	黄河旋风	5,400	47,088.00	0.12
211	603826	坤彩科技	800	47,088.00	0.12
212	002335	科华数据	1,500	46,275.00	0.12
213	002079	苏州固锝	3,100	46,252.00	0.12
214	688408	中信博	500	46,240.00	0.12
215	300398	飞凯材料	2,020	46,177.20	0.12
216	300573	兴齐眼药	300	45,996.00	0.12
217	002832	比音勒芬	1,820	45,864.00	0.12
218	300638	广和通	1,731	45,854.19	0.12

219	300772	运达股份	1,800	45,792.00	0.12
220	600252	中恒集团	15,500	45,725.00	0.12
221	300233	金城医药	1,600	45,648.00	0.12
222	300443	金雷股份	1,000	45,580.00	0.12
223	601212	白银有色	16,500	45,540.00	0.12
224	002567	唐人神	5,350	45,528.50	0.12
225	000049	德赛电池	1,005	45,325.50	0.12
226	002254	泰和新材	2,700	45,225.00	0.12
227	601208	东材科技	3,500	45,220.00	0.12
228	600197	伊力特	1,500	45,150.00	0.12
229	600502	安徽建工	6,256	45,043.20	0.12
230	600363	联创光电	2,000	44,920.00	0.12
231	300065	海兰信	3,425	44,867.50	0.12
232	000657	中钨高新	2,980	44,700.00	0.12
233	000403	派林生物	2,033	44,644.68	0.12
234	300456	赛微电子	2,440	44,603.20	0.12
235	688023	安恒信息	300	44,298.00	0.12
236	300379	东方通	2,500	44,025.00	0.12
237	603308	应流股份	2,700	43,956.00	0.12
238	601918	新集能源	8,600	43,860.00	0.12
239	688617	惠泰医疗	200	43,816.00	0.12
240	600821	金开新能	6,800	43,792.00	0.11
241	601126	四方股份	2,700	43,767.00	0.11
242	002810	山东赫达	1,200	43,668.00	0.11
243	002099	海翔药业	6,300	43,659.00	0.11
244	300451	创业慧康	6,057	43,610.40	0.11
245	600621	华鑫股份	3,000	43,560.00	0.11
246	002984	森麒麟	1,400	43,554.00	0.11
247	000672	上峰水泥	2,760	43,552.80	0.11
248	603128	华贸物流	4,340	43,530.20	0.11
249	688037	芯源微	300	43,491.00	0.11
250	601311	骆驼股份	3,900	43,407.00	0.11
251	300841	康华生物	375	43,290.00	0.11
251	600916	中国黄金	3,700	43,290.00	0.11
252	300203	聚光科技	1,800	43,272.00	0.11
253	000426	兴业矿业	6,100	43,249.00	0.11
254	601952	苏垦农发	3,090	43,229.10	0.11
255	002332	仙琚制药	4,400	43,208.00	0.11
256	603098	森特股份	1,200	43,032.00	0.11
257	300036	超图软件	2,200	42,988.00	0.11
258	300726	宏达电子	700	42,819.00	0.11
259	600210	紫江企业	6,700	42,813.00	0.11

260	002163	海南发展	3,000	42,810.00	0.11
261	600305	恒顺醋业	3,316	42,776.40	0.11
262	000951	中国重汽	3,260	42,347.40	0.11
263	600586	金晶科技	5,600	42,280.00	0.11
264	600267	海正药业	3,300	42,273.00	0.11
265	300737	科顺股份	3,200	42,176.00	0.11
266	600720	祁连山	3,400	42,160.00	0.11
267	300224	正海磁材	2,750	42,075.00	0.11
268	002171	楚江新材	4,500	41,985.00	0.11
269	000917	电广传媒	7,900	41,949.00	0.11
270	300773	拉卡拉	2,200	41,932.00	0.11
271	002123	梦网科技	3,600	41,904.00	0.11
272	300188	美亚柏科	3,100	41,788.00	0.11
273	603666	亿嘉和	608	41,708.80	0.11
274	002413	雷科防务	7,500	41,625.00	0.11
275	600496	精工钢构	9,000	41,580.00	0.11
276	002063	远光软件	5,908	41,533.24	0.11
277	300662	科锐国际	800	41,512.00	0.11
278	688339	亿华通	420	41,319.60	0.11
279	300696	爱乐达	940	41,313.00	0.11
280	600850	电科数字	2,210	41,238.60	0.11
281	300079	数码视讯	7,900	41,238.00	0.11
282	301035	润丰股份	500	41,225.00	0.11
283	300087	荃银高科	2,500	41,150.00	0.11
284	002201	正威新材	1,580	41,001.00	0.11
285	600185	格力地产	6,480	40,888.80	0.11
286	603306	华懋科技	1,200	40,680.00	0.11
287	600562	国睿科技	2,732	40,570.20	0.11
288	002324	普利特	2,800	40,544.00	0.11
289	002626	金达威	1,700	40,528.00	0.11
290	600888	新疆众和	4,400	40,480.00	0.11
291	600459	贵研铂业	2,235	40,475.85	0.11
292	000915	华特达因	970	40,109.50	0.11
293	000090	天健集团	5,800	39,962.00	0.10
294	600986	浙文互联	6,440	39,670.40	0.10
295	600993	马应龙	1,700	39,610.00	0.10
296	000034	神州数码	2,600	39,572.00	0.10
297	000650	仁和药业	6,200	39,556.00	0.10
298	603919	金徽酒	1,160	39,428.40	0.10
299	600116	三峡水利	3,900	39,156.00	0.10
300	601028	玉龙股份	2,200	39,072.00	0.10
301	002518	科士达	1,275	39,015.00	0.10

302	002727	一心堂	1,700	38,981.00	0.10
303	688016	心脉医疗	200	38,962.00	0.10
304	601137	博威合金	2,200	38,940.00	0.10
305	603489	八方股份	200	38,898.00	0.10
306	600688	上海石化	12,200	38,796.00	0.10
307	002726	龙大美食	3,624	38,631.84	0.10
308	600869	远东股份	7,500	38,625.00	0.10
309	600552	凯盛科技	3,400	38,522.00	0.10
310	002400	省广集团	7,800	38,454.00	0.10
311	688516	奥特维	144	38,440.80	0.10
312	002239	奥特佳	12,600	38,430.00	0.10
313	000767	晋控电力	10,300	38,419.00	0.10
314	688033	天宜上佳	1,800	38,232.00	0.10
315	300236	上海新阳	1,150	38,065.00	0.10
316	600740	山西焦化	6,536	38,039.52	0.10
317	000582	北部湾港	4,900	38,024.00	0.10
318	002041	登海种业	1,800	37,962.00	0.10
319	600685	中船防务	2,300	37,927.00	0.10
320	002217	合力泰	12,100	37,873.00	0.10
321	000712	锦龙股份	2,500	37,725.00	0.10
322	600770	综艺股份	4,300	37,625.00	0.10
323	300855	图南股份	900	37,611.00	0.10
324	000016	深康佳 A	6,200	37,510.00	0.10
324	000627	天茂集团	11,000	37,510.00	0.10
325	002428	云南锗业	2,900	37,468.00	0.10
326	600477	杭萧钢构	7,870	37,461.20	0.10
327	002556	辉隆股份	3,200	37,440.00	0.10
328	603979	金诚信	1,934	37,345.54	0.10
329	300674	宇信科技	2,380	37,318.40	0.10
330	600320	振华重工	11,100	37,296.00	0.10
331	300075	数字政通	2,100	37,212.00	0.10
332	002895	川恒股份	1,100	37,191.00	0.10
333	600682	南京新百	3,700	37,074.00	0.10
334	300639	凯普生物	1,729	36,966.02	0.10
335	002100	天康生物	3,800	36,936.00	0.10
336	600877	声光电科	3,300	36,894.00	0.10
337	300821	东岳硅材	2,000	36,760.00	0.10
338	600908	无锡银行	6,500	36,595.00	0.10
339	603187	海容冷链	1,000	36,550.00	0.10
340	601369	陕鼓动力	3,800	36,480.00	0.10
341	603583	捷昌驱动	1,092	36,461.88	0.10
342	600422	昆药集团	3,000	36,450.00	0.10

343	300401	花园生物	2,100	36,414.00	0.10
344	301155	海力风电	400	36,400.00	0.10
345	600963	岳阳林纸	6,030	36,360.90	0.10
346	600075	新疆天业	5,680	36,295.20	0.10
347	688520	神州细胞	700	36,211.00	0.10
348	601519	大智慧	5,600	36,176.00	0.09
349	300323	华灿光电	4,800	36,144.00	0.09
350	000503	国新健康	4,000	35,920.00	0.09
351	002261	拓维信息	5,600	35,896.00	0.09
352	300208	青岛中程	2,550	35,878.50	0.09
353	603323	苏农银行	7,010	35,751.00	0.09
354	600610	中毅达	2,100	35,700.00	0.09
355	000969	安泰科技	4,000	35,680.00	0.09
356	601965	中国汽研	2,200	35,662.00	0.09
357	600635	大众公用	10,800	35,640.00	0.09
358	000921	海信家电	2,500	35,450.00	0.09
359	002085	万丰奥威	6,600	35,442.00	0.09
360	002759	天际股份	1,300	35,334.00	0.09
361	688133	泰坦科技	200	35,328.00	0.09
362	603018	华设集团	3,688	35,220.40	0.09
363	300170	汉得信息	3,900	35,139.00	0.09
364	002645	华宏科技	1,600	34,912.00	0.09
365	000848	承德露露	3,600	34,848.00	0.09
366	600452	涪陵电力	3,000	34,830.00	0.09
366	600966	博汇纸业	4,500	34,830.00	0.09
367	002446	盛路通信	5,020	34,788.60	0.09
368	000735	罗牛山	5,100	34,782.00	0.09
368	002023	海特高新	3,400	34,782.00	0.09
368	600491	龙元建设	5,100	34,782.00	0.09
369	600578	京能电力	11,100	34,743.00	0.09
370	600163	中闽能源	4,100	34,645.00	0.09
371	300027	华谊兄弟	10,800	34,560.00	0.09
372	600761	安徽合力	2,900	34,510.00	0.09
373	002262	恩华药业	2,536	34,489.60	0.09
374	002108	沧州明珠	5,542	34,471.24	0.09
375	002130	沃尔核材	5,600	34,384.00	0.09
376	002639	雪人股份	3,000	34,380.00	0.09
377	002214	大立科技	2,700	34,344.00	0.09
378	000727	冠捷科技	15,100	34,277.00	0.09
379	002960	青鸟消防	1,250	34,237.50	0.09
380	600360	华微电子	4,300	34,142.00	0.09
381	688198	佰仁医疗	280	34,137.60	0.09

382	000923	河钢资源	2,500	34,075.00	0.09
383	002612	朗姿股份	1,200	33,936.00	0.09
384	688166	博瑞医药	1,400	33,810.00	0.09
385	600797	浙大网新	5,700	33,744.00	0.09
386	688018	乐鑫科技	300	33,720.00	0.09
387	300055	万邦达	3,600	33,696.00	0.09
388	002649	博彦科技	3,300	33,693.00	0.09
389	300653	正海生物	600	33,600.00	0.09
390	300525	博思软件	1,560	33,462.00	0.09
391	300497	富祥药业	2,488	33,438.72	0.09
392	002928	华夏航空	2,825	33,250.25	0.09
393	002698	博实股份	2,800	33,124.00	0.09
394	600490	鹏欣资源	8,600	33,110.00	0.09
395	600645	中源协和	1,700	33,099.00	0.09
396	300428	立中集团	1,000	33,050.00	0.09
397	300326	凯利泰	4,000	33,040.00	0.09
398	603229	奥翔药业	868	33,036.08	0.09
399	600059	古越龙山	3,000	33,000.00	0.09
400	000612	焦作万方	5,300	32,913.00	0.09
401	002226	江南化工	5,860	32,874.60	0.09
402	600933	爱柯迪	2,000	32,760.00	0.09
403	603505	金石资源	800	32,728.00	0.09
404	300369	绿盟科技	3,100	32,612.00	0.09
405	601963	重庆银行	4,100	32,554.00	0.09
406	002859	洁美科技	1,180	32,473.60	0.09
407	300755	华致酒行	740	32,449.00	0.09
408	600587	新华医疗	1,600	32,400.00	0.09
409	002020	京新药业	3,560	32,396.00	0.09
410	003031	中瓷电子	500	32,300.00	0.08
411	300263	隆华科技	3,600	32,256.00	0.08
411	600812	华北制药	4,800	32,256.00	0.08
412	603348	文灿股份	600	32,160.00	0.08
413	300151	昌红科技	1,700	32,130.00	0.08
414	300477	合纵科技	4,160	32,032.00	0.08
415	002222	福晶科技	1,950	31,980.00	0.08
416	603733	仙鹤股份	1,200	31,920.00	0.08
417	002545	东方铁塔	2,800	31,864.00	0.08
418	300229	拓尔思	2,800	31,780.00	0.08
419	300470	中密控股	900	31,761.00	0.08
420	002537	海联金汇	3,880	31,738.40	0.08
421	688366	昊海生科	300	31,734.00	0.08
422	002467	二六三	7,630	31,588.20	0.08

423	600395	盘江股份	3,600	31,572.00	0.08
424	603520	司太立	1,120	31,494.40	0.08
425	600248	陕西建工	5,800	31,494.00	0.08
426	000935	四川双马	1,300	31,486.00	0.08
427	002498	汉缆股份	7,400	31,450.00	0.08
428	000681	视觉中国	2,200	31,438.00	0.08
429	300348	长亮科技	3,250	31,395.00	0.08
430	000059	华锦股份	5,300	31,376.00	0.08
431	002237	恒邦股份	3,200	31,360.00	0.08
432	600285	羚锐制药	2,500	31,325.00	0.08
433	002276	万马股份	4,000	31,280.00	0.08
433	688106	金宏气体	1,600	31,280.00	0.08
434	603043	广州酒家	1,240	31,272.80	0.08
435	605168	三人行	289	31,249.57	0.08
436	600675	中华企业	10,200	31,212.00	0.08
437	300973	立高食品	300	31,185.00	0.08
438	002274	华昌化工	3,200	31,168.00	0.08
439	002635	安洁科技	1,900	31,103.00	0.08
440	002038	双鹭药业	3,200	31,072.00	0.08
441	002581	未名医药	1,800	31,032.00	0.08
442	301071	力量钻石	200	31,026.00	0.08
443	300131	英唐智控	5,900	30,916.00	0.08
444	002611	东方精工	5,940	30,888.00	0.08
444	300377	赢时胜	3,300	30,888.00	0.08
445	300596	利安隆	700	30,877.00	0.08
446	300827	上能电气	600	30,690.00	0.08
447	002135	东南网架	3,200	30,624.00	0.08
448	002481	双塔食品	3,600	30,564.00	0.08
449	000851	高鸿股份	6,400	30,528.00	0.08
450	300102	乾照光电	4,000	30,520.00	0.08
451	301050	雷电微力	300	30,468.00	0.08
452	000555	神州信息	2,700	30,456.00	0.08
453	600108	亚盛集团	8,700	30,450.00	0.08
454	600750	江中药业	2,120	30,358.40	0.08
455	600072	中船科技	2,500	30,350.00	0.08
456	002206	海利得	4,800	30,336.00	0.08
457	603995	甬金股份	900	30,294.00	0.08
458	002293	罗莱生活	2,300	30,291.00	0.08
459	002283	天润工业	4,400	30,052.00	0.08
460	300633	开立医疗	1,000	30,030.00	0.08
461	000682	东方电子	4,500	29,970.00	0.08
462	002488	金固股份	4,450	29,948.50	0.08

463	300352	北信源	6,475	29,914.50	0.08
464	002773	康弘药业	2,000	29,880.00	0.08
465	603010	万盛股份	1,600	29,840.00	0.08
466	000688	国城矿业	1,900	29,811.00	0.08
467	603298	杭叉集团	1,920	29,625.60	0.08
468	603305	旭升股份	980	29,615.60	0.08
469	603916	苏博特	1,160	29,568.40	0.08
470	603393	新天然气	1,384	29,562.24	0.08
471	600073	上海梅林	3,700	29,489.00	0.08
472	603301	振德医疗	700	29,435.00	0.08
473	603566	普莱柯	1,100	29,403.00	0.08
474	600557	康缘药业	2,000	29,380.00	0.08
475	600223	鲁商发展	2,800	29,344.00	0.08
476	603529	爱玛科技	560	29,332.80	0.08
477	603033	三维股份	1,300	29,302.00	0.08
478	000795	英洛华	3,800	29,260.00	0.08
479	600612	老凤祥	700	29,246.00	0.08
480	002061	浙江交科	4,200	29,232.00	0.08
481	688007	光峰科技	1,200	29,160.00	0.08
482	000927	中国铁物	10,100	29,088.00	0.08
483	002043	兔宝宝	2,500	29,000.00	0.08
484	000758	中色股份	6,000	28,980.00	0.08
484	300031	宝通科技	1,800	28,980.00	0.08
485	002837	英维克	1,170	28,945.80	0.08
486	300598	诚迈科技	700	28,903.00	0.08
487	300133	华策影视	5,800	28,884.00	0.08
488	002421	达实智能	8,600	28,810.00	0.08
489	000789	万年青	2,650	28,726.00	0.08
490	688266	泽璟制药	800	28,712.00	0.08
491	600420	国药现代	2,900	28,710.00	0.08
492	300394	天孚通信	1,060	28,694.20	0.08
493	603363	傲农生物	1,550	28,690.50	0.08
494	002550	千红制药	5,000	28,650.00	0.08
495	300663	科蓝软件	1,850	28,638.00	0.08
496	601890	亚星锚链	3,700	28,564.00	0.08
497	600428	中远海特	6,000	28,560.00	0.07
498	300303	聚飞光电	5,940	28,512.00	0.07
499	300184	力源信息	5,140	28,270.00	0.07
500	600284	浦东建设	3,800	28,158.00	0.07
501	605123	派克新材	200	28,144.00	0.07
502	000901	航天科技	3,093	28,115.37	0.07
503	300355	蒙草生态	7,100	27,974.00	0.07

504	002158	汉钟精机	1,200	27,900.00	0.07
505	300761	立华股份	700	27,825.00	0.07
506	600742	一汽富维	2,996	27,802.88	0.07
507	000966	长源电力	4,600	27,784.00	0.07
508	300232	洲明科技	4,248	27,696.96	0.07
509	600512	腾达建设	8,900	27,679.00	0.07
510	300180	华峰超纤	6,900	27,669.00	0.07
511	300406	九强生物	1,600	27,664.00	0.07
512	000592	平潭发展	10,500	27,615.00	0.07
513	300222	科大智能	3,420	27,565.20	0.07
514	601619	嘉泽新能	6,700	27,470.00	0.07
515	600211	西藏药业	660	27,396.60	0.07
516	603396	金辰股份	300	27,309.00	0.07
517	600169	太原重工	11,100	27,306.00	0.07
518	600523	贵航股份	1,160	27,260.00	0.07
519	603936	博敏电子	2,000	27,240.00	0.07
520	600125	铁龙物流	5,100	27,234.00	0.07
521	300738	奥飞数据	2,376	27,205.20	0.07
522	002190	成飞集成	1,000	27,200.00	0.07
523	000968	蓝焰控股	2,600	27,170.00	0.07
524	600158	中体产业	3,300	27,159.00	0.07
525	688568	中科星图	400	27,104.00	0.07
526	300177	中海达	3,350	27,101.50	0.07
527	600751	海航科技	10,000	27,100.00	0.07
528	603368	柳药集团	1,570	27,035.40	0.07
529	300158	振东制药	4,000	27,000.00	0.07
530	600984	建设机械	4,160	26,956.80	0.07
531	300284	苏交科	3,852	26,848.44	0.07
532	600575	淮河能源	8,600	26,832.00	0.07
533	601011	宝泰隆	6,400	26,752.00	0.07
534	300226	上海钢联	1,180	26,727.00	0.07
535	002746	仙坛股份	2,915	26,672.25	0.07
536	600997	开滦股份	3,500	26,670.00	0.07
537	603997	继峰股份	2,450	26,656.00	0.07
538	300382	斯莱克	1,700	26,639.00	0.07
539	603113	金能科技	2,400	26,544.00	0.07
540	000976	华铁股份	6,200	26,474.00	0.07
541	600331	宏达股份	7,900	26,465.00	0.07
542	600458	时代新材	2,700	26,460.00	0.07
543	601929	吉视传媒	12,900	26,445.00	0.07
544	000560	我爱我家	9,180	26,438.40	0.07
545	300287	飞利信	6,400	26,432.00	0.07

546	002847	盐津铺子	300	26,382.00	0.07
547	000913	钱江摩托	1,500	26,340.00	0.07
548	601015	陕西黑猫	4,500	26,325.00	0.07
549	603766	隆鑫通用	5,700	26,277.00	0.07
550	600691	阳煤化工	6,500	26,260.00	0.07
551	603989	艾华集团	930	26,226.00	0.07
552	600657	信达地产	3,800	26,182.00	0.07
553	300894	火星人	700	26,173.00	0.07
554	688158	优刻得	1,800	26,154.00	0.07
555	600017	日照港	8,600	26,144.00	0.07
556	600971	恒源煤电	3,300	26,070.00	0.07
557	002589	瑞康医药	6,700	26,063.00	0.07
558	000088	盐田港	5,000	26,050.00	0.07
559	300039	上海凯宝	4,100	25,994.00	0.07
560	600955	维远股份	900	25,956.00	0.07
561	301047	义翘神州	200	25,946.00	0.07
562	000603	盛达资源	2,300	25,944.00	0.07
563	002741	光华科技	1,300	25,909.00	0.07
564	600531	豫光金铅	4,900	25,823.00	0.07
565	300319	麦捷科技	2,800	25,816.00	0.07
566	600103	青山纸业	10,270	25,777.70	0.07
567	600602	云赛智联	3,600	25,776.00	0.07
568	600789	鲁抗医药	3,940	25,767.60	0.07
569	600308	华泰股份	4,500	25,695.00	0.07
570	600864	哈投股份	5,100	25,653.00	0.07
571	600662	外服控股	3,800	25,650.00	0.07
572	000811	冰轮环境	2,450	25,553.50	0.07
573	000989	九芝堂	2,805	25,525.50	0.07
574	002106	莱宝高科	3,100	25,358.00	0.07
575	002310	东方园林	10,500	25,305.00	0.07
576	603801	志邦家居	936	25,253.28	0.07
577	603896	寿仙谷	650	25,207.00	0.07
578	000543	皖能电力	6,300	25,137.00	0.07
579	301089	拓新药业	200	25,124.00	0.07
580	000498	山东路桥	2,600	25,116.00	0.07
581	000036	华联控股	5,810	25,099.20	0.07
582	603718	海利生物	2,185	25,083.80	0.07
583	002737	葵花药业	1,600	25,024.00	0.07
584	600391	航发科技	1,300	24,973.00	0.07
585	300143	盈康生命	2,200	24,970.00	0.07
586	000006	深振业 A	5,300	24,963.00	0.07
587	600643	爱建集团	4,200	24,906.00	0.07

588	002646	天佑德酒	1,300	24,895.00	0.07
589	002055	得润电子	2,000	24,880.00	0.07
590	002930	宏川智慧	1,258	24,870.66	0.07
591	300709	精研科技	840	24,855.60	0.07
592	603387	基蛋生物	1,742	24,840.92	0.07
593	605369	拱东医疗	200	24,840.00	0.07
594	300149	睿智医药	2,200	24,816.00	0.07
595	601609	金田股份	3,300	24,783.00	0.07
596	002833	弘亚数控	1,484	24,753.12	0.06
597	688027	国盾量子	244	24,644.00	0.06
598	002034	旺能环境	1,200	24,636.00	0.06
599	002967	广电计量	1,300	24,622.00	0.06
600	600266	城建发展	6,000	24,480.00	0.06
601	002097	山河智能	3,600	24,444.00	0.06
602	300123	亚光科技	3,940	24,428.00	0.06
603	002194	武汉凡谷	2,300	24,334.00	0.06
604	603636	南威软件	2,000	24,300.00	0.06
605	002440	闰土股份	3,000	24,180.00	0.06
606	600581	八一钢铁	4,300	24,166.00	0.06
607	688586	江航装备	907	24,135.27	0.06
608	001696	宗申动力	3,800	24,054.00	0.06
609	600335	国机汽车	2,400	24,024.00	0.06
610	600326	西藏天路	4,100	23,985.00	0.06
611	300266	兴源环境	6,100	23,973.00	0.06
612	600649	城投控股	5,600	23,968.00	0.06
613	300267	尔康制药	6,900	23,943.00	0.06
614	002425	凯撒文化	4,280	23,925.20	0.06
615	300219	鸿利智汇	2,750	23,925.00	0.06
616	000676	智度股份	4,300	23,908.00	0.06
617	601686	友发集团	3,100	23,684.00	0.06
618	603881	数据港	880	23,628.00	0.06
619	600776	东方通信	2,100	23,625.00	0.06
620	000567	海德股份	1,595	23,606.00	0.06
621	003012	东鹏控股	2,700	23,598.00	0.06
622	000828	东莞控股	2,300	23,575.00	0.06
623	000557	西部创业	4,900	23,569.00	0.06
624	000061	农产品	3,800	23,560.00	0.06
625	603915	国茂股份	1,120	23,508.80	0.06
626	300770	新媒股份	620	23,454.60	0.06
627	000881	中广核技	2,600	23,452.00	0.06
628	603686	福龙马	2,360	23,411.20	0.06
629	300007	汉威科技	1,300	23,387.00	0.06

630	000903	云内动力	7,700	23,331.00	0.06
631	601606	长城军工	2,000	23,220.00	0.06
632	688578	艾力斯	1,100	23,210.00	0.06
633	000065	北方国际	2,742	23,169.90	0.06
634	000801	四川九洲	3,400	23,154.00	0.06
635	002218	拓日新能	3,900	22,971.00	0.06
636	600480	凌云股份	2,580	22,936.20	0.06
637	002697	红旗连锁	4,540	22,927.00	0.06
638	000507	珠海港	3,600	22,860.00	0.06
639	000615	奥园美谷	3,000	22,830.00	0.06
640	002777	久远银海	1,586	22,806.68	0.06
641	688399	硕世生物	200	22,804.00	0.06
642	000652	泰达股份	5,700	22,800.00	0.06
643	688383	新益昌	200	22,750.00	0.06
644	300119	瑞普生物	1,300	22,737.00	0.06
645	300702	天宇股份	800	22,728.00	0.06
646	002573	清新环境	3,900	22,659.00	0.06
647	300792	壹网壹创	700	22,638.00	0.06
648	300735	光弘科技	2,166	22,634.70	0.06
649	002307	北新路桥	3,800	22,610.00	0.06
650	600783	XD鲁信创	1,700	22,542.00	0.06
651	600876	洛阳玻璃	900	22,518.00	0.06
652	603959	百利科技	1,856	22,494.72	0.06
653	688233	神工股份	400	22,480.00	0.06
654	601702	华峰铝业	1,700	22,440.00	0.06
655	300109	新开源	1,374	22,423.68	0.06
656	688508	芯朋微	300	22,350.00	0.06
657	600343	航天动力	2,100	22,344.00	0.06
658	600550	保变电气	4,100	22,263.00	0.06
659	002489	浙江永强	6,100	22,204.00	0.06
660	600604	市北高新	3,800	22,192.00	0.06
661	002285	世联行	6,800	22,168.00	0.06
662	600105	永鼎股份	6,140	22,165.40	0.06
663	002838	道恩股份	900	22,104.00	0.06
664	000070	特发信息	3,180	22,101.00	0.06
665	002449	国星光电	2,730	22,085.70	0.06
666	000928	中钢国际	3,520	22,070.40	0.06
667	600746	江苏索普	1,900	22,002.00	0.06
668	300085	银之杰	2,000	21,980.00	0.06
669	601886	江河集团	2,600	21,970.00	0.06
670	603429	集友股份	1,708	21,964.88	0.06
671	603025	大豪科技	1,000	21,840.00	0.06

672	300311	任子行	3,031	21,762.58	0.06
673	002733	雄韬股份	1,250	21,762.50	0.06
674	002437	誉衡药业	8,600	21,758.00	0.06
675	000823	超声电子	2,100	21,714.00	0.06
676	002035	华帝股份	3,730	21,708.60	0.06
677	002941	新疆交建	1,400	21,700.00	0.06
678	688699	明微电子	200	21,692.00	0.06
679	002614	奥佳华	2,500	21,650.00	0.06
680	300846	首都在线	1,600	21,632.00	0.06
681	600775	南京熊猫	2,200	21,560.00	0.06
682	300020	银江技术	2,900	21,547.00	0.06
683	000030	富奥股份	3,900	21,372.00	0.06
684	300900	广联航空	800	21,360.00	0.06
685	600929	雪天盐业	2,300	21,344.00	0.06
686	603299	苏盐井神	1,700	21,301.00	0.06
687	300292	吴通控股	6,000	21,300.00	0.06
688	301217	铜冠铜箔	1,400	21,294.00	0.06
689	603920	世运电路	1,230	21,279.00	0.06
690	603601	再升科技	3,340	21,242.40	0.06
691	002461	珠江啤酒	2,500	21,200.00	0.06
692	000025	特力 A	900	21,195.00	0.06
693	002677	浙江美大	1,440	21,124.80	0.06
694	300271	华宇软件	2,800	21,056.00	0.06
695	002320	海峡股份	3,700	21,053.00	0.06
696	000539	粤电力 A	5,000	21,000.00	0.06
697	002516	旷达科技	4,100	20,992.00	0.06
698	601588	北辰实业	8,900	20,826.00	0.05
699	688526	科前生物	800	20,792.00	0.05
700	002351	漫步者	2,450	20,727.00	0.05
701	002234	民和股份	1,300	20,722.00	0.05
702	300657	弘信电子	1,780	20,683.60	0.05
703	600990	四创电子	500	20,675.00	0.05
704	002768	国恩股份	800	20,544.00	0.05
705	300366	创意信息	2,400	20,520.00	0.05
706	300205	天喻信息	1,700	20,519.00	0.05
707	300091	金通灵	5,020	20,481.60	0.05
708	300145	中金环境	7,440	20,460.00	0.05
709	000697	炼石航空	2,600	20,436.00	0.05
710	600639	浦东金桥	1,500	20,385.00	0.05
711	000597	东北制药	3,700	20,350.00	0.05
712	600810	神马股份	2,260	20,340.00	0.05
713	002891	中宠股份	800	20,336.00	0.05

714	600510	黑牡丹	2,300	20,309.00	0.05
715	603609	禾丰股份	2,100	20,223.00	0.05
716	688127	蓝特光学	900	20,214.00	0.05
717	002367	康力电梯	2,700	20,169.00	0.05
718	688277	天智航	1,400	20,146.00	0.05
719	300130	新国都	1,640	20,106.40	0.05
720	002376	新北洋	2,600	20,098.00	0.05
721	000710	贝瑞基因	1,400	20,076.00	0.05
722	603068	博通集成	500	19,985.00	0.05
723	300762	上海瀚讯	1,792	19,944.96	0.05
724	601827	三峰环境	2,800	19,936.00	0.05
725	600696	岩石股份	700	19,922.00	0.05
726	688095	福昕软件	280	19,880.00	0.05
727	300328	宜安科技	2,320	19,720.00	0.05
727	600565	迪马股份	8,500	19,720.00	0.05
728	300276	三丰智能	4,680	19,702.80	0.05
729	600694	大商股份	1,100	19,690.00	0.05
730	000566	海南海药	4,300	19,651.00	0.05
731	300191	潜能恒信	900	19,584.00	0.05
732	002534	西子洁能	1,200	19,548.00	0.05
733	603060	国检集团	1,622	19,545.10	0.05
734	300078	思创医惠	3,824	19,540.64	0.05
735	000950	重药控股	3,900	19,500.00	0.05
736	600449	宁夏建材	1,600	19,472.00	0.05
737	600729	重庆百货	900	19,413.00	0.05
738	002251	步步高	2,800	19,404.00	0.05
739	600184	光电股份	1,400	19,376.00	0.05
740	002243	力合科创	2,000	19,300.00	0.05
741	000550	江铃汽车	1,200	19,296.00	0.05
742	603118	共进股份	2,600	19,292.00	0.05
743	600337	美克家居	6,300	19,278.00	0.05
744	300114	中航电测	1,650	19,272.00	0.05
745	300740	水羊股份	1,400	19,236.00	0.05
746	002292	奥飞娱乐	4,100	19,229.00	0.05
747	300183	东软载波	1,300	19,227.00	0.05
748	603728	鸣志电器	900	19,107.00	0.05
749	600217	中再资环	3,900	19,032.00	0.05
750	000931	中关村	2,900	19,024.00	0.05
750	002298	中电兴发	2,900	19,024.00	0.05
751	601069	西部黄金	1,400	19,012.00	0.05
752	600114	东睦股份	2,380	18,992.40	0.05
753	300607	拓斯达	1,436	18,983.92	0.05

754	300910	瑞丰新材	300	18,966.00	0.05
755	300378	鼎捷软件	1,150	18,940.50	0.05
756	002664	长鹰信质	1,100	18,898.00	0.05
757	600748	上实发展	5,100	18,870.00	0.05
758	300867	圣元环保	900	18,828.00	0.05
759	002204	大连重工	4,300	18,791.00	0.05
760	300579	数字认证	750	18,750.00	0.05
761	002782	可立克	1,100	18,744.00	0.05
762	002959	小熊电器	300	18,699.00	0.05
763	600590	泰豪科技	2,860	18,675.80	0.05
764	002314	南山控股	4,500	18,630.00	0.05
765	603212	赛伍技术	700	18,627.00	0.05
766	601882	海天精工	900	18,549.00	0.05
767	603960	克来机电	900	18,495.00	0.05
768	603466	风语筑	960	18,470.40	0.05
769	002215	诺普信	3,300	18,447.00	0.05
770	300045	华力创通	2,400	18,408.00	0.05
771	300322	硕贝德	2,100	18,396.00	0.05
772	300423	昇辉科技	1,700	18,394.00	0.05
773	002605	姚记科技	1,100	18,315.00	0.05
774	300307	慈星股份	3,000	18,270.00	0.05
775	002918	蒙娜丽莎	970	18,158.40	0.05
776	000601	韶能股份	3,600	18,144.00	0.05
776	600715	文投控股	7,200	18,144.00	0.05
777	603108	润达医疗	1,840	18,124.00	0.05
778	002017	东信和平	1,500	18,075.00	0.05
779	300080	易成新能	3,600	18,072.00	0.05
780	300429	强力新材	1,903	18,059.47	0.05
781	002979	雷赛智能	880	17,969.60	0.05
782	002042	华孚时尚	4,750	17,955.00	0.05
783	002929	润建股份	500	17,950.00	0.05
784	300842	帝科股份	300	17,880.00	0.05
785	603328	依顿电子	2,800	17,780.00	0.05
786	000958	电投产融	3,900	17,706.00	0.05
787	603055	台华新材	1,400	17,584.00	0.05
788	600032	浙江新能	1,200	17,580.00	0.05
789	300783	三只松鼠	700	17,535.00	0.05
790	300602	飞荣达	1,069	17,531.60	0.05
791	603595	东尼电子	424	17,506.96	0.05
792	300397	天和防务	1,680	17,488.80	0.05
793	002267	陕天然气	2,500	17,475.00	0.05
794	300204	舒泰神	1,300	17,446.00	0.05

795	300624	万兴科技	540	17,274.60	0.05
796	000813	德展健康	5,000	17,250.00	0.05
797	601330	绿色动力	2,200	17,226.00	0.05
798	002803	吉宏股份	1,300	17,225.00	0.05
799	300723	一品红	640	17,216.00	0.05
800	002987	京北方	868	17,195.08	0.05
801	605388	均瑶健康	1,000	17,170.00	0.05
802	300455	康拓红外	2,000	17,140.00	0.05
803	601158	重庆水务	3,200	17,120.00	0.04
804	300134	大富科技	2,100	17,115.00	0.04
805	600710	苏美达	2,900	17,110.00	0.04
806	300590	移为通信	1,260	17,098.20	0.04
807	002522	浙江众成	3,000	17,040.00	0.04
808	002950	奥美医疗	1,350	17,037.00	0.04
809	300659	中孚信息	800	17,016.00	0.04
810	000791	甘肃电投	3,020	17,002.60	0.04
811	002378	章源钨业	2,100	16,968.00	0.04
812	300768	迪普科技	1,050	16,957.50	0.04
813	300548	博创科技	950	16,929.00	0.04
814	000600	建投能源	4,000	16,880.00	0.04
815	300829	金丹科技	520	16,858.40	0.04
816	002344	海宁皮城	3,600	16,812.00	0.04
817	002717	岭南股份	5,580	16,795.80	0.04
818	688100	威胜信息	800	16,792.00	0.04
819	600569	安阳钢铁	6,400	16,768.00	0.04
820	300523	辰安科技	600	16,734.00	0.04
821	000048	京基智农	900	16,713.00	0.04
822	301080	百普赛斯	100	16,689.00	0.04
823	002435	长江健康	3,400	16,626.00	0.04
824	002993	奥海科技	400	16,624.00	0.04
825	603337	杰克股份	772	16,582.56	0.04
826	000910	大亚圣象	1,800	16,506.00	0.04
827	603416	信捷电气	400	16,456.00	0.04
828	300206	理邦仪器	1,600	16,400.00	0.04
829	601700	风范股份	3,200	16,352.00	0.04
830	603313	梦百合	1,361	16,332.00	0.04
831	301029	怡合达	200	16,300.00	0.04
832	600098	广州发展	2,600	16,276.00	0.04
833	600618	氯碱化工	1,300	16,250.00	0.04
834	688505	复旦张江	1,600	16,240.00	0.04
835	000936	华西股份	3,000	16,230.00	0.04
836	600007	中国国贸	1,100	16,225.00	0.04

837	000011	深物业 A	1,200	16,212.00	0.04
838	300527	中船应急	2,143	16,201.08	0.04
839	300255	常山药业	2,600	16,198.00	0.04
840	603877	太平鸟	800	16,192.00	0.04
841	600261	阳光照明	4,800	16,176.00	0.04
842	002724	海洋王	1,300	16,159.00	0.04
843	600874	创业环保	2,400	16,152.00	0.04
844	300132	青松股份	2,300	16,100.00	0.04
844	603533	掌阅科技	1,000	16,100.00	0.04
845	688368	晶丰明源	100	15,986.00	0.04
846	002301	齐心集团	2,400	15,840.00	0.04
847	002913	奥士康	500	15,825.00	0.04
848	600996	贵广网络	2,300	15,824.00	0.04
849	688389	普门科技	900	15,741.00	0.04
850	300510	金冠股份	3,179	15,736.05	0.04
851	603105	芯能科技	1,400	15,652.00	0.04
852	002232	启明信息	1,100	15,510.00	0.04
853	002978	安宁股份	400	15,452.00	0.04
854	300552	万集科技	500	15,370.00	0.04
855	603693	江苏新能	800	15,360.00	0.04
856	300368	汇金股份	2,100	15,309.00	0.04
857	600548	深高速	1,600	15,264.00	0.04
858	002662	京威股份	4,200	15,246.00	0.04
859	300799	左江科技	200	15,040.00	0.04
860	603359	东珠生态	1,244	15,027.52	0.04
861	000032	深桑达 A	1,000	14,980.00	0.04
862	301177	迪阿股份	200	14,840.00	0.04
863	002303	美盈森	4,300	14,835.00	0.04
864	002912	中新赛克	600	14,796.00	0.04
865	300616	尚品宅配	520	14,794.00	0.04
866	000761	本钢板材	4,100	14,760.00	0.04
867	688278	特宝生物	500	14,740.00	0.04
868	300006	莱美药业	3,538	14,682.70	0.04
869	603169	兰石重装	2,200	14,586.00	0.04
870	300441	鲍斯股份	2,160	14,580.00	0.04
871	601949	中国出版	3,000	14,460.00	0.04
872	002636	金安国纪	1,600	14,448.00	0.04
873	603208	江山欧派	200	14,446.00	0.04
874	300215	电科院	2,100	14,427.00	0.04
875	300872	天阳科技	1,080	14,396.40	0.04
876	003040	楚天龙	700	14,392.00	0.04
877	601515	东风股份	3,120	14,383.20	0.04

878	301031	中熔电气	100	14,338.00	0.04
879	003021	兆威机电	300	14,331.00	0.04
880	605136	丽人丽妆	900	14,238.00	0.04
881	605090	九丰能源	700	14,189.00	0.04
882	002530	金财互联	2,120	14,161.60	0.04
883	688268	华特气体	200	14,052.00	0.04
884	003009	中天火箭	300	14,037.00	0.04
885	300365	恒华科技	2,000	14,000.00	0.04
885	688318	财富趋势	140	14,000.00	0.04
886	603730	岱美股份	1,065	13,962.15	0.04
887	002609	捷顺科技	1,800	13,914.00	0.04
888	000019	深粮控股	1,800	13,878.00	0.04
889	603508	思维列控	1,036	13,872.04	0.04
890	603222	济民医疗	1,260	13,860.00	0.04
891	301069	凯盛新材	300	13,833.00	0.04
892	002991	甘源食品	200	13,798.00	0.04
893	300981	中红医疗	540	13,618.80	0.04
894	605007	五洲特纸	700	13,608.00	0.04
895	002695	煌上煌	1,100	13,607.00	0.04
896	300485	赛升药业	1,100	13,585.00	0.04
897	000918	嘉凯城	5,900	13,570.00	0.04
898	600800	渤海化学	3,300	13,563.00	0.04
899	300386	飞天诚信	1,200	13,524.00	0.04
900	600855	航天长峰	1,200	13,476.00	0.04
901	603610	麒盛科技	992	13,401.92	0.04
902	000639	西王食品	3,024	13,366.08	0.04
903	300127	银河磁体	700	13,363.00	0.04
904	300439	美康生物	1,100	13,354.00	0.04
905	002651	利君股份	1,700	13,345.00	0.04
906	002977	天箭科技	280	13,252.40	0.03
907	300765	新诺威	918	13,099.86	0.03
908	000885	城发环境	1,400	13,020.00	0.03
909	002641	公元股份	2,700	13,014.00	0.03
909	300856	科思股份	300	13,014.00	0.03
910	003032	传智教育	900	12,915.00	0.03
911	301087	可孚医疗	300	12,792.00	0.03
912	300634	彩讯股份	1,000	12,700.00	0.03
913	605339	南侨食品	500	12,685.00	0.03
914	688788	科思科技	280	12,658.80	0.03
915	002961	瑞达期货	700	12,628.00	0.03
916	603013	亚普股份	900	12,573.00	0.03
917	300684	中石科技	900	12,555.00	0.03

918	300531	优博讯	900	12,510.00	0.03
919	605199	葫芦娃	700	12,355.00	0.03
920	605589	圣泉集团	500	12,335.00	0.03
921	001213	中铁特货	2,500	12,275.00	0.03
922	605338	巴比食品	400	12,204.00	0.03
923	688128	中国电研	500	12,175.00	0.03
924	603180	金牌厨柜	392	12,136.32	0.03
925	605507	国邦医药	500	12,075.00	0.03
926	600935	华塑股份	2,300	12,052.00	0.03
927	603587	地素时尚	760	12,046.00	0.03
928	688085	三友医疗	550	11,907.50	0.03
929	603567	珍宝岛	1,000	11,870.00	0.03
930	603439	贵州三力	900	11,808.00	0.03
931	300318	博晖创新	1,800	11,772.00	0.03
932	603626	科森科技	1,580	11,739.40	0.03
933	605009	豪悦护理	300	11,664.00	0.03
934	605222	起帆电缆	500	11,385.00	0.03
935	002970	锐明技术	400	11,300.00	0.03
936	002990	盛视科技	400	11,276.00	0.03
937	688222	成都先导	700	11,172.00	0.03
938	000517	荣安地产	3,500	11,130.00	0.03
939	002880	卫光生物	420	11,054.40	0.03
940	301090	华润材料	1,000	10,910.00	0.03
941	601921	浙版传媒	1,400	10,892.00	0.03
942	603071	物产环能	600	10,884.00	0.03
943	301039	中集车辆	1,000	10,830.00	0.03
944	603093	南华期货	1,000	10,590.00	0.03
945	603378	亚士创能	906	10,563.96	0.03
946	300815	玉禾田	600	10,434.00	0.03
947	000058	深赛格	1,700	10,302.00	0.03
948	002287	奇正藏药	400	10,300.00	0.03
949	002792	通宇通讯	850	10,251.00	0.03
950	300857	协创数据	500	10,245.00	0.03
951	688055	龙腾光电	1,900	10,241.00	0.03
952	603258	电魂网络	500	10,125.00	0.03
953	605008	长鸿高科	700	9,814.00	0.03
954	003039	顺控发展	400	9,660.00	0.03
955	300860	锋尚文化	200	9,446.00	0.02
956	300791	仙乐健康	300	9,366.00	0.02
957	603053	成都燃气	1,000	9,340.00	0.02
958	300942	易瑞生物	400	9,240.00	0.02
959	003006	百亚股份	700	8,638.00	0.02

960	603530	神马电力	500	8,595.00	0.02
961	688001	华兴源创	300	8,166.00	0.02
962	688020	方邦股份	200	7,798.00	0.02
963	600903	贵州燃气	1,000	7,790.00	0.02
964	300785	值得买	298	7,789.72	0.02
965	002975	博杰股份	200	7,650.00	0.02
966	601528	瑞丰银行	900	7,254.00	0.02
967	301060	兰卫医学	200	7,004.00	0.02
968	605296	神农集团	260	6,684.60	0.02
969	688365	光云科技	700	6,510.00	0.02
970	301015	百洋医药	300	6,474.00	0.02
971	300788	中信出版	300	6,180.00	0.02
972	002911	佛燃能源	680	6,174.40	0.02
973	601279	英利汽车	900	6,147.00	0.02
974	600841	动力新科	700	6,062.00	0.02
975	301078	孩子王	400	5,864.00	0.02
976	603171	税友股份	200	5,596.00	0.01
977	603103	横店影视	380	5,346.60	0.01
978	605099	共创草坪	200	5,318.00	0.01
979	688315	诺禾致源	200	5,154.00	0.01
980	605365	立达信	300	4,971.00	0.01
981	301180	万祥科技	200	4,190.00	0.01
982	603511	爱慕股份	200	3,494.00	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	601089	福元医药	810	17,050.50	0.04
2	001268	联合精密	204	5,654.88	0.01

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	002405	四维图新	187,199.00	0.35
2	002432	九安医疗	129,786.00	0.24
3	000422	湖北宜化	107,849.00	0.20
4	601099	太平洋	107,625.00	0.20
5	688063	派能科技	107,340.00	0.20
6	002472	双环传动	90,168.00	0.17
7	002497	雅化集团	90,000.00	0.17
8	600096	云天化	88,208.00	0.16

9	002176	江特电机	88,042.00	0.16
10	300012	华测检测	87,171.00	0.16
11	600872	中炬高新	85,330.00	0.16
12	300343	联创股份	83,880.00	0.16
13	601677	明泰铝业	79,595.00	0.15
14	002044	美年健康	76,284.00	0.14
15	000683	远兴能源	74,510.00	0.14
16	688116	天奈科技	70,716.00	0.13
17	300390	天华超净	69,377.00	0.13
18	002240	盛新锂能	69,376.00	0.13
19	002407	多氟多	68,658.00	0.13
20	600873	梅花生物	68,355.00	0.13

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	300012	华测检测	340,232.00	0.63
2	002497	雅化集团	318,856.00	0.59
3	002240	盛新锂能	292,629.00	0.54
4	600096	云天化	290,614.00	0.54
5	300769	德方纳米	269,205.70	0.50
6	300073	当升科技	240,658.00	0.45
7	300390	天华超净	238,397.00	0.44
8	002756	永兴材料	237,995.00	0.44
9	002407	多氟多	230,507.89	0.43
10	688122	西部超导	219,859.68	0.41
11	600499	科达制造	204,892.00	0.38
12	601058	赛轮轮胎	202,309.80	0.38
13	002625	光启技术	179,564.00	0.33
14	603026	石大胜华	172,376.00	0.32
15	002326	永太科技	168,738.20	0.31
16	000831	五矿稀土	160,278.00	0.30
17	605117	德业股份	132,102.60	0.25
18	002176	江特电机	129,353.00	0.24
19	688598	金博股份	124,528.00	0.23
20	688116	天奈科技	119,868.00	0.22

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	19,806,028.22
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	26,100,146.22
--------------	---------------

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投资。

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投资。

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 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 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝中证 1000 指数基金截至 2022 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的天奈科技(688116)的发行人江苏天奈科技股份有限公司因存在补充流动资金的 15,000 万元实际上并未用于生产经营，而是全部用于购买银行理财产品，实际用途与公司公告不符，信息披露不真实的违规行为，于 2021 年 12 月 8 日收到江苏证监局采取责令改正的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 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	9,620.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,644.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,264.09

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 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

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 (%)
3,899	9,237.52	-	-	36,017,103.47	100.00

8.2 期末上市基金前十名持有人

8.3 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	0.00	0.0000

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	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年11月19日) 基金份额总额	41,884,507.09
本报告期期初基金份额总额	44,943,274.25
本报告期基金总申购份额	22,838,201.20
减：本报告期基金总赎回份额	31,764,371.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	36,017,103.47

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

2022年4月18日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，XIAOYI HELEN HUANG（黄小慧）不再担任公司总经理，公司副总经理向辉代为履行总经理职责。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、基金财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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

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

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 (%)	
东方证券	2	27,299,109.29	59.50	25,423.25	59.50	-
光大证券	1	18,454,187.31	40.22	17,186.22	40.22	-
招商证券	2	100,314.20	0.22	91.43	0.21	-
国泰君安	2	24,192.00	0.05	22.05	0.05	-
华安证券	1	6,035.92	0.01	5.63	0.01	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券 华南	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：资历雄厚，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、本基金本报告期新增交易单元：山西证券、国融证券；退租交易单元：中信证券华南。

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 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 华南	-	-	-	-	-	-
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 指数证券投资基金	基金管理人网站	2022-01-24

	2021 年第 4 季度报告		
2	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022-03-31
3	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022-04-22
4	华宝基金关于旗下部分基金新增中 国人寿为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海 证券报, 证券日报, 证 券时报, 中国证券报	2022-06-15
5	华宝基金关于旗下部分开放式基金 参加建设银行定投费率优惠活动的 公告	基金管理人网站, 上海 证券报, 证券日报, 证 券时报, 中国证券报	2022-06-17
6	华宝中证 1000 指数证券投资基金托 管协议	基金管理人网站	2022-06-24
7	华宝中证 1000 指数证券投资基金基 金合同	基金管理人网站	2022-06-24
8	华宝中证 1000 指数证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要 (更 新)	基金管理人网站	2022-06-24
9	华宝中证 1000 指数证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要 (更 新)	基金管理人网站	2022-06-24
10	华宝中证 1000 指数证券投资基金招 募说明书 (更新)	基金管理人网站	2022-06-24
11	华宝基金管理有限公司关于华宝中 证 1000 指数证券投资基金增加 C 类 基金份额并修改基金合同的公告	基金管理人网站, 证券 日报	2022-06-24

§ 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

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 (%)
个人	1	20220419~202 20425	0.00	16,746,912.2 9	16,746,912.2 9	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产</p>							

的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2022 年 06 月 24 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

本公司于 2022 年 5 月完成工商变更登记，公司变更后的股东信息为：华宝信托有限责任公司（持股 51%）、Warburg Pincus Asset Management, L.P.（“华平投资”，持股 29%）、江苏省铁路集团有限公司（持股 20%）。

§ 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 指数证券投资基金基金合同；
华宝中证 1000 指数证券投资基金招募说明书；
华宝中证 1000 指数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

2022 年 8 月 31 日