

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，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。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
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	82
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	82
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	82
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	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	82
§ 9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末上市基金前十名持有人	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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	84
§ 10 开放式基金份额变动	84
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
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	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	87
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	89
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	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 1000ETF
场内简称	中证 1000ETF（扩位证券简称：中证 1000 指数 ETF）
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	156,602,182.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 24 日

注：本基金于 2022 年 7 月 28 日扩位证券简称由“1000ETF 基金”变更为“中证 1000 指数 ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	1、股票的投资策略；2、存托凭证的投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货的投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、融资及转融通证券出借业务
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

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		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一 路 111 号

办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	200135	518000
法定代表人	贾波	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

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）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 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	2022 年	2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日） -2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-9,404,893.50	2,034,836.12
本期利润	-24,514,078.93	5,797,925.17
加权平均基金份额本期利润	-0.2276	0.1390
本期加权平均净值利润率	-21.29%	12.39%
本期基金份额净值增长率	-20.85%	26.69%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	416,709.35	4,395,137.19
期末可供分配基金份额利润	0.0027	0.1032
期末基金资产净值	157,018,891.35	53,971,358.62
期末基金份额净值	1.0027	1.2669
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净	0.27%	26.69%

值增长率		
------	--	--

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

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

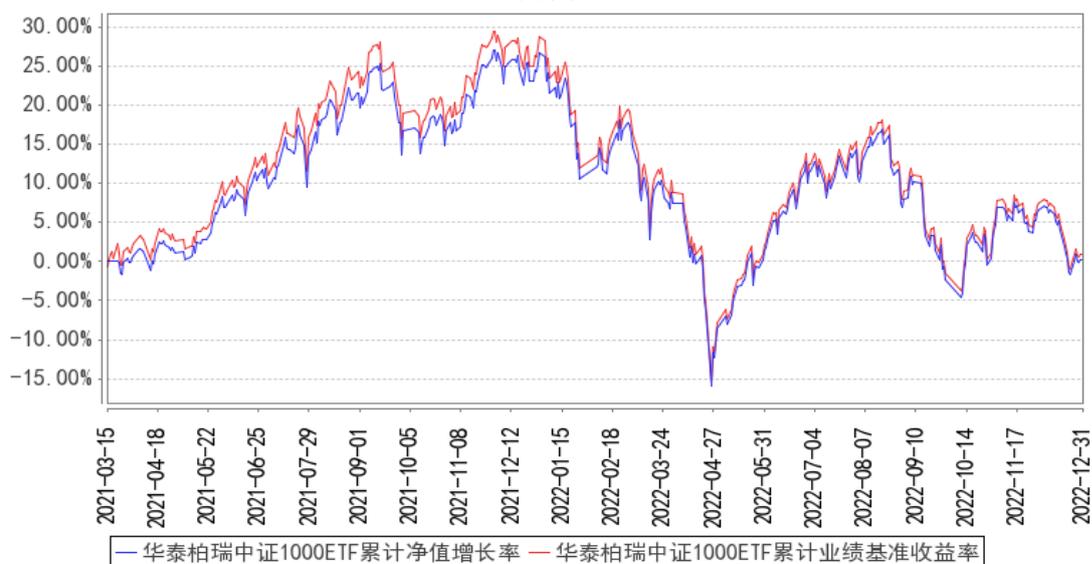
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.64%	1.19%	2.56%	1.20%	0.08%	-0.01%
过去六个月	-10.03%	1.26%	-10.21%	1.27%	0.18%	-0.01%
过去一年	-20.85%	1.56%	-21.58%	1.59%	0.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.27%	1.37%	0.98%	1.41%	-0.71%	-0.04%

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

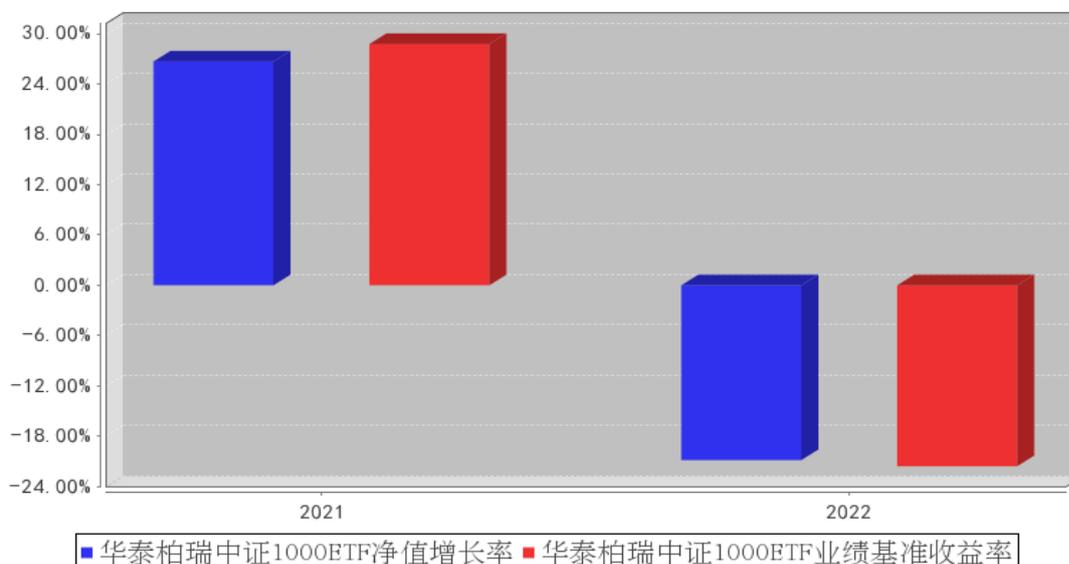
华泰柏瑞中证1000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2021 年 3 月 15 日至 2022 年 12 月 31 日。

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

华泰柏瑞中证1000ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2021 年 3 月 15 日起生效，2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升

级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪

港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)。截至 2022 年 12 月 31

日，公司基金管理规模为 3,091.70 亿元。

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		
李茜	本基金的基金经理	2021 年 3 月 15 日	-	7 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。

注：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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

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

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，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》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报

告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

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 年市场以结构性机会为主，其中煤炭、综合板块、社会服务、交通运输的表现相对较好，涨跌幅分别为 10.95%、10.57%、-2.23%和-3.41%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-21.63%、-20.31%、-21.58%和-29.37%。从市场风格来看，价值风格表现优于成长风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-14.51%和-30.69%，中证 500 价值相对中证 500 成长亦获得了显著的超额收益。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.034%，期间日跟踪误差为 0.045%，较好地实现了本基金的投资目标。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0027 元；本报告期基金份额净值增长率为-20.85%，业绩比较基准收益率为-21.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年，在俄乌冲突全面爆发之后，全球滞胀格局加剧，传统能源以及资源运输成为全年表现最为亮眼的行业；对于国内而言，疫情防控与房地产政策的变化始终影响着投资者的基本面预期，宏观波动率成为了定价的核心。展望 2023 年，疫情缓和与地产政策边际回暖，海外通胀持续回落、美联储加息放缓几乎已成共识。从投资的角度，较艰难的时刻或许已经过去。在市场盈利增速修复的背景下，当前较低的估值水平下指数获得估值修复的概率更大，市场整体 Beta 机会不可忽视。风格上，全年存在大小盘风格切换行情，海外加息放缓与“中国式现代化”特征的估值体系或成为风格切换的核心变量。行业层面，从海外经验，疫情达峰后带动消费复苏，食品饮料、旅游出行等板块或会有修复性行情。同时，关注政策边际变化、可能困境反转的行业，比如地产、大金融板块。最后，关注景气改善的行业，比如光伏、TMT 等行业。即便如此，投资者在未来一段时间内依然时刻面临着诸多的不确定性，比如国内经济复苏的程度、海外经济衰退的程度等，

投资或仍需谨慎乐观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 416,709.35 元。

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

注：无。

§ 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

本报告期内，招商证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 24700 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证 1000ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞中证 1000ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞中证 1000ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞中证 1000ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞中证 1000ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞中证 1000ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞中证 1000ETF 基金的财务报告过程。</p>

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,630,492.59	1,643,084.32
结算备付金		116,114.91	16,838.11
存出保证金		233,023.04	49,014.88
交易性金融资产	7.4.7.2	155,413,737.80	52,483,308.28
其中：股票投资		155,346,073.54	52,473,708.28
基金投资		-	-
债券投资		67,664.26	9,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		659,325.41	209,892.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	792.23
资产总计		159,052,693.75	54,402,930.03
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	618.70
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		768,405.65	9,248.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		71,513.52	22,214.05
应付托管费		14,302.70	4,442.80
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.53	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,179,580.00	395,047.15
负债合计		2,033,802.40	431,571.41
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	156,602,182.00	42,602,182.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	416,709.35	11,369,176.62
净资产合计		157,018,891.35	53,971,358.62
负债和净资产总计		159,052,693.75	54,402,930.03

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0027 元，基金份额总额 156,602,182.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 15 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-23,495,243.78	6,969,198.36
1. 利息收入		35,974.00	115,407.22
其中：存款利息收入	7.4.7.13	35,974.00	115,390.63
债券利息收入		-	16.59
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）		-9,241,519.10	2,854,871.45
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-10,012,555.05	2,646,716.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	84,087.07	14,764.77
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	686,948.88	193,390.25
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）	7.4.7.20	-15,109,185.43	3,763,089.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	819,486.75	235,830.64
减：二、营业总支出		1,018,835.15	1,171,273.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	565,695.79	184,340.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	113,139.24	36,868.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.12	-
8. 其他费用	7.4.7.23	340,000.00	950,064.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,514,078.93	5,797,925.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,514,078.93	5,797,925.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,514,078.93	5,797,925.17

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62
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)	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	114,000,000.00	-	-10,952,467.27	103,047,532.73
(一)、综合收益总额	-	-	-24,514,078.93	-24,514,078.93
(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)	114,000,000.00	-	13,561,611.66	127,561,611.66
其中：1. 基金申购款	291,000,000.00	-	24,491,049.96	315,491,049.96
2. 基金赎回款	-177,000,000.00	-	-10,929,438.30	-187,929,438.30
(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、本期期末净资产(基金净值)	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
项目	上年度可比期间			
	2021年3月15日(基金合同生效日)至2021年12月31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)	-	-	-	-
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)	222,602,182.00	-	-	222,602,182.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-180,000,000.00	-	11,369,176.62	-168,630,823.38

(一)、综合收益总额	-	-	5,797,925.17	5,797,925.17
(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)	-180,000,000.00	-	5,571,251.45	-174,428,748.55
其中：1. 基金申购款	84,000,000.00	-	11,895,237.32	95,895,237.32
2. 基金赎回款	-264,000,000.00	-	-6,323,985.87	-270,323,985.87
(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、本期期末净资产(基金净值)	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62

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：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 222,600,550.00 元(含募集股票市值),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(2021)第 0294 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞

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 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,632.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准，本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12

月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产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。比较财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 15 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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列

示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际

利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，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，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符

合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证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和债券，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)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,财政部于 2022 年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14 号),中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款,金额分别为 1,643,084.32 元、16,838.11 元、49,014.88 元、792.23 元和 209,892.21 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款,金额分别为 1,643,842.95 元、16,846.47 元、49,039.19 元、0.00 元和 209,892.21 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 52,483,308.28 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 52,483,309.21 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 9,248.71 元、22,214.05 元、4,442.80 元、

31,182.40 元和 193,864.75 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,248.71 元、22,214.05 元、4,442.80 元、31,182.40 元和 193,864.75 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 618.70 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 618.70 元。

(ii) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,630,492.59	1,643,084.32
等于：本金	2,629,045.00	1,643,084.32
加：应计利息	1,447.59	-
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	2,630,492.59	1,643,084.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		166,696,623.92	-	155,346,073.54	-11,350,550.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	63,200.00	10.26	67,664.26	4,454.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	63,200.00	10.26	67,664.26	4,454.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		166,759,823.92	10.26	155,413,737.80	-11,346,096.38
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		48,712,552.23	-	52,473,708.28	3,761,156.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	-	9,600.00	1,600.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,000.00	-	9,600.00	1,600.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		48,720,552.23	-	52,483,308.28	3,762,756.05

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	792.23
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	792.23

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 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	-	-
应付交易费用	142,727.12	31,182.40
其中：交易所市场	142,727.12	31,182.40
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	210,000.00	170,000.00
应退退补款	826,852.88	193,864.75
合计	1,179,580.00	395,047.15

7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,602,182.00	42,602,182.00
本期申购	291,000,000.00	291,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-177,000,000.00	-177,000,000.00
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	156,602,182.00	156,602,182.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

7.4.7.12 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	4,395,137.19	6,974,039.43	11,369,176.62
本期利润	-9,404,893.50	-15,109,185.43	-24,514,078.93
本期基金份额交易产生的变动数	8,571,251.33	4,990,360.33	13,561,611.66
其中：基金申购款	18,941,946.39	5,549,103.57	24,491,049.96
基金赎回款	-10,370,695.06	-558,743.24	-10,929,438.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,561,495.02	-3,144,785.67	416,709.35

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	31,038.25	107,952.14
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	3,344.08	5,230.32
其他	1,591.67	2,208.17
合计	35,974.00	115,390.63

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月15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	-7,534,160.12	2,255,459.88
股票投资收益——赎回差价收入	-2,478,394.93	391,256.55
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	-10,012,555.05	2,646,716.43

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	157,331,260.21	182,184,575.02
减：卖出股票成本总额	164,293,587.11	179,929,115.14
减：交易费用	571,833.22	-
买卖股票差价收入	-7,534,160.12	2,255,459.88

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月15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	187,929,438.30	270,323,985.87
减：现金支付赎回款总额	122,086,189.30	179,064,958.87
减：赎回股票成本总额	68,321,643.93	90,867,770.45
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-2,478,394.93	391,256.55

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	90.02	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	83,997.05	14,764.77
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	84,087.07	14,764.77

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月15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	409,893.28	78,380.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	325,800.00	63,600.00
减：应计利息总额	81.77	15.66
减：交易费用	14.46	-
买卖债券差价收入	83,997.05	14,764.77

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年3月15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	686,948.88	193,390.25
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	686,948.88	193,390.25

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年3月15日（基金合 同生效日）至2021年12月31 日
1. 交易性金融资产	-15,108,852.43	3,762,756.05
股票投资	-15,111,706.43	3,761,156.05
债券投资	2,854.00	1,600.00
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	-333.00	333.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-15,109,185.43	3,763,089.05

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年3月15日（基金合 同生效日）至2021年12月
----	---------------------------------	---

		31 日
基金赎回费收入	-	-
现金认购款利息	-	47,281.33
替代损益	819,486.75	188,549.31
合计	819,486.75	235,830.64

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
注册登记费(中登上海)	150,000.00	125,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00	20,000.00
其他费用	-	400.00
交易费用	-	654,664.82
合计	340,000.00	950,064.82

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

证券”)	
------	--

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年3月15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（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
招商证券	403,174,430.29	100.00	470,582,163.94	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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（%）
招商证券	371,862.52	100.00	142,727.12	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年3月15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（%）
招商证券	430,714.51	100.00	31,182.40	100.00

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月15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	565,695.79	184,340.35
其中：支付销售机构的客户维护费	5,365.77	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月15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	113,139.24	36,868.02

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

日托管费=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

注：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。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 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（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

华泰证券股份有限公司	1,400,462.00	0.8943	5,502,662.00	12.9164
------------	--------------	--------	--------------	---------

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

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 2022年1月1日至2022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：张）	总金额
华泰联合证券	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	496	19,309.28
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	4,925	81,311.75
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	4,043	75,927.54
华泰联合证券	301327	华宝新能	网下申购	725	172,187.50
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	1,100	53,856.00
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	1,711	75,437.99
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	2,311	62,397.00
华泰联合证券	123145	药石转债	网上配售	98	9,800.00
华泰联合证券	113650	博22转债	网上配售	40	4,000.00
招商证券	110091	合力转债	网上配售	370	37,000.00
招商证券	000065	北方国际	网上配售	900	4,644.00
上年度可比期间 2021年3月15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：张）	总金额
华泰联合证券、招商证券	600941	中国移动	网上配售	1,000	57,580.00
华泰联合证券、招商证券	601728	中国电信	网上配售	10,000	45,300.00
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上配售	11,000	29,150.00
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	265	16,795.70
招商证券	001288	运机集团	网下申购	432	6,285.60
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	286	4,727.58

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 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	受限期	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
301152	天力锂电	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	57.00	46.64	169	9,633.00	7,882.16	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定期内	18.66	21.73	312	5,821.92	6,779.76	-
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	32.38	31.61	229	7,415.02	7,238.69	-
301171	易点天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	18.18	17.72	279	5,072.22	4,943.88	-
301176	逸豪新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	23.88	16.89	280	6,686.40	4,729.20	-
301227	森鹰窗业	2022 年 9 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	38.25	29.49	204	7,803.00	6,015.96	-
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	40.00	48.32	157	6,280.00	7,586.24	-
301231	荣信文化	2022 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301265	华新环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	13.28	11.40	318	4,223.04	3,625.20	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	50.88	66.20	124	6,309.12	8,208.80	-
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301277	新天地	2022 年	6 个月	新股锁	27.00	25.78	232	6,264.00	5,980.96	-

		11月9日		定期内							
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股锁定期内	30.38	25.25	220	6,683.60	5,555.00		-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股锁定期内	52.69	51.41	123	6,480.87	6,323.43		-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股锁定期内	14.60	12.60	383	5,591.80	4,825.80		-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股锁定期内	44.09	35.13	172	7,583.48	6,042.36		-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股锁定期内	18.19	14.90	478	8,694.82	7,122.20		-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定期内	8.48	12.99	675	5,724.00	8,768.25		-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股锁定期内	36.15	29.37	123	4,446.45	3,612.51		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定期内	5.00	7.53	1,207	6,035.00	9,088.71		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定期内	39.00	24.46	115	4,485.00	2,812.90		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股锁定期内	13.88	15.86	536	7,439.68	8,500.96		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股锁定期内	25.25	29.14	183	4,620.75	5,332.62		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定期内	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定期内	47.75	53.27	80	3,820.00	4,261.60		-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股锁定期内	51.72	36.62	154	7,964.88	5,639.48		-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股锁定期内	237.50	176.97	73	17,337.50	12,918.81		-
301328	维峰电	2022年	6个月	新股锁	78.80	76.96	87	6,855.60	6,695.52		-

	子	8月30日		定期内						
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股锁定期内	18.78	15.59	405	7,605.90	6,313.95	-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股锁定期内	138.88	103.52	46	6,388.48	4,761.92	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股锁定期内	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股锁定期内	26.44	20.96	351	9,280.44	7,356.96	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定期内	30.66	37.85	182	5,580.12	6,888.70	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股锁定期内	119.88	175.78	51	6,113.88	8,964.78	-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股锁定期内	25.88	21.60	169	4,373.72	3,650.40	-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	新股锁定期内	40.13	31.90	222	8,908.86	7,081.80	-
600459	贵研铂业	2022年12月22日	1个月内(含)	配股未上市	10.91	15.74	2,700	29,457.00	42,498.00	-
688132	邦彦技术	2022年9月16日	6个月	新股锁定期内	28.88	22.80	2,180	62,958.40	49,704.00	-
688432	有研硅	2022年11月3日	6个月	新股锁定期内	9.91	11.24	6,213	61,570.83	69,834.12	-
688525	佰维存储	2022年12月23日	6个月	新股锁定期内	13.99	15.27	2,922	40,878.78	44,618.94	-
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	受限期	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
110091	合力转债	2022年12月13日	1个月	配债未上市	100.00	100.00	370	37,003.08	37,003.08	-

127077	华宏转债	2022 年 12 月 02 日	1 个月	配债未 上市	100.00	100.00	62	6,201.22	6,201.22	-
--------	------	------------------------	------	-----------	--------	--------	----	----------	----------	---

注：1、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。

2、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内

容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于交通银行的托管账户，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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%(2021 年 12 月 31 日：0.02%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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 7.4.12。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%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。

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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,630,492.59	-	-	-	-	-	2,630,492.59

结算备付金	116,114.91	-	-	-	-	-	116,114.91
存出保证金	233,023.04	-	-	-	-	-	233,023.04
交易性金融资产	-	-	-	-67,664.26	155,346,073.54	155,413,737.80	
应收清算款	-	-	-	-	-	659,325.41	659,325.41
资产总计	2,979,630.54	-	-	-67,664.26	156,005,398.95	159,052,693.75	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	71,513.52	71,513.52
应付托管费	-	-	-	-	-	14,302.70	14,302.70
应付清算款	-	-	-	-	-	768,405.65	768,405.65
应交税费	-	-	-	-	-	0.53	0.53
其他负债	-	-	-	-	-	1,179,580.00	1,179,580.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,033,802.40	2,033,802.40
利率敏感度缺口	2,979,630.54	-	-	-67,664.26	153,971,596.55	157,018,891.35	
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,643,084.32	-	-	-	-	-	1,643,084.32
结算备付金	16,838.11	-	-	-	-	-	16,838.11
存出保证金	49,014.88	-	-	-	-	-	49,014.88
交易性金融资产	-	-	-	-	9,600.00	52,473,708.28	52,483,308.28
应收清算款	-	-	-	-	-	209,892.21	209,892.21
其他资产	-	-	-	-	-	792.23	792.23
资产总计	1,708,937.31	-	-	-	9,600.00	52,684,392.72	54,402,930.03
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	618.70	618.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,214.05	22,214.05
应付托管费	-	-	-	-	-	4,442.80	4,442.80
应付清算款	-	-	-	-	-	9,248.71	9,248.71
其他负债	-	-	-	-	-	395,047.15	395,047.15
负债总计	-	-	-	-	-	431,571.41	431,571.41
利率敏感度缺口	1,708,937.31	-	-	-	9,600.00	52,252,821.31	53,971,358.62

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04% (2021 年 12 月 31 日：0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	155,346,073.54	98.93	52,473,708.28	97.23
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	-	-	-618.70	-
合计	155,346,073.54	98.93	52,473,089.58	97.23

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		
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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	中证 1000 指数上升 5%	7,616,337.89	2,519,494.17
	中证 1000 指数下降	-7,616,337.89	-2,519,494.17

	5%		
--	----	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	154,935,138.65	52,378,910.70
第二层次	85,702.30	104,397.58
第三层次	392,896.85	-
合计	155,413,737.80	52,483,308.28

7.4.14.2.2 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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	404,897.03	404,897.03
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-12,000.18	-12,000.18
其中：计入损益的利得或损失	-	-12,000.18	-12,000.18
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	392,896.85	392,896.85
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-12,000.18	-12,000.18
项目	上年度可比同期 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	392,896.85	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2022 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 315,491,049.96 元(2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间：95,895,237.32 元)，其中包括以股票支付的申购款 99,574,503.00 元和以现金支付的申购款 215,916,546.96 元(2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间：其中包括以股票支付的申购款 29,720,977.00 元和以现金支付的申购款 66,174,260.32 元)。

(2) 除基金申购款外，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	155,346,073.54	97.67
	其中：股票	155,346,073.54	97.67

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,664.26	0.04
	其中：债券	67,664.26	0.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,746,607.50	1.73
8	其他各项资产	892,348.45	0.56
9	合计	159,052,693.75	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	947,967.00	0.60
B	采矿业	4,436,082.80	2.83
C	制造业	106,970,153.71	68.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,450,576.60	2.83
E	建筑业	2,961,481.00	1.89
F	批发和零售业	4,307,559.00	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,236,912.12	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,503,973.01	8.60
J	金融业	3,562,480.00	2.27
K	房地产业	3,174,333.00	2.02
L	租赁和商务服务业	1,120,496.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	2,008,804.31	1.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,958,855.60	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	70,766.00	0.05
Q	卫生和社会工作	610,637.00	0.39
R	文化、体育和娱乐	1,235,893.50	0.79

	业		
S	综合	138,504.00	0.09
	合计	154,695,474.65	98.52

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	585,660.27	0.37
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	34,770.83	0.02
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	16,354.49	0.01
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	8,208.80	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	650,598.89	0.41

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002176	江特电机	43,300	755,585.00	0.48

2	002405	四维图新	60,500	666,710.00	0.42
3	300438	鹏辉能源	8,300	647,317.00	0.41
4	000933	神火股份	40,100	599,896.00	0.38
5	002240	盛新锂能	15,800	592,342.00	0.38
6	600872	中炬高新	15,600	575,172.00	0.37
7	300395	菲利华	10,250	563,750.00	0.36
8	600559	老白干酒	18,600	512,058.00	0.33
9	002432	九安医疗	9,800	500,878.00	0.32
10	000423	东阿阿胶	11,500	468,050.00	0.30
11	300068	南都电源	21,600	460,080.00	0.29
12	301050	雷电微力	5,900	455,303.00	0.29
13	300118	东方日升	18,100	449,242.00	0.29
14	601677	明泰铝业	24,560	445,518.40	0.28
15	601099	太平洋	173,000	444,610.00	0.28
16	002472	双环传动	17,300	440,285.00	0.28
17	002317	众生药业	16,200	437,238.00	0.28
18	002044	美年健康	69,600	426,648.00	0.27
19	600338	西藏珠峰	18,300	419,436.00	0.27
20	688598	金博股份	1,885	413,719.80	0.26
21	002312	川发龙蟒	38,500	405,020.00	0.26
22	002463	沪电股份	33,800	402,220.00	0.26
23	000762	西藏矿业	10,400	401,544.00	0.26
24	002335	科华数据	8,000	399,120.00	0.25
25	300054	鼎龙股份	18,600	395,994.00	0.25
26	000860	顺鑫农业	13,200	393,624.00	0.25
27	000818	航锦科技	13,900	380,165.00	0.24
28	300339	润和软件	20,300	376,971.00	0.24
29	600711	盛屯矿业	63,800	375,782.00	0.24
30	688050	爱博医疗	1,626	375,118.20	0.24
31	300035	中科电气	18,200	374,556.00	0.24
32	300777	中简科技	7,600	373,540.00	0.24
33	002262	恩华药业	15,000	368,250.00	0.23
34	688516	奥特维	1,828	367,428.00	0.23
35	688556	高测股份	4,825	361,971.50	0.23
36	002389	航天彩虹	17,500	359,975.00	0.23
37	301035	润丰股份	4,100	357,110.00	0.23
38	000690	宝新能源	54,600	354,900.00	0.23
39	600596	新安股份	23,260	352,156.40	0.22
40	002487	大金重工	8,500	351,645.00	0.22
41	300034	钢研高纳	7,500	343,800.00	0.22
42	600771	广誉远	12,300	342,186.00	0.22
43	002245	蔚蓝锂芯	22,900	340,752.00	0.22
44	600583	海油工程	56,100	339,966.00	0.22

45	002436	兴森科技	35,100	339,768.00	0.22
46	002402	和而泰	23,200	338,256.00	0.22
47	000422	湖北宜化	22,800	335,388.00	0.21
48	601975	招商南油	84,800	334,112.00	0.21
49	002518	科士达	5,800	334,080.00	0.21
50	002036	联创电子	27,000	333,990.00	0.21
51	603236	移远通信	3,310	333,714.20	0.21
52	688200	华峰测控	1,205	333,146.35	0.21
53	300725	药石科技	4,100	330,050.00	0.21
54	605589	圣泉集团	15,400	329,406.00	0.21
55	300393	中来股份	21,900	324,558.00	0.21
56	002484	江海股份	14,500	324,365.00	0.21
57	002610	爱康科技	113,700	324,045.00	0.21
58	300666	江丰电子	4,600	318,320.00	0.20
59	300346	南大光电	10,900	316,645.00	0.20
60	688139	海尔生物	5,000	316,500.00	0.20
61	600416	湘电股份	16,800	315,840.00	0.20
62	000893	亚钾国际	11,600	315,288.00	0.20
63	300593	新雷能	7,400	314,352.00	0.20
64	601222	林洋能源	36,400	312,676.00	0.20
65	600481	双良节能	23,800	307,972.00	0.20
66	300502	新易盛	12,900	306,375.00	0.20
67	603027	千禾味业	14,720	305,881.60	0.19
68	300203	聚光科技	9,000	305,100.00	0.19
69	000875	吉电股份	49,600	302,064.00	0.19
70	002541	鸿路钢构	10,300	301,687.00	0.19
71	600777	新潮能源	138,100	301,058.00	0.19
72	600185	格力地产	28,700	299,341.00	0.19
73	300487	蓝晓科技	4,300	299,237.00	0.19
74	600456	宝钛股份	7,300	298,278.00	0.19
75	600129	太极集团	9,900	297,594.00	0.19
76	002865	钧达股份	1,600	296,160.00	0.19
77	300327	中颖电子	8,300	293,571.00	0.19
78	300298	三诺生物	8,700	293,451.00	0.19
79	300775	三角防务	7,700	292,600.00	0.19
80	603338	浙江鼎力	6,100	291,885.00	0.19
81	605111	新洁能	3,760	291,700.80	0.19
82	603713	密尔克卫	2,500	291,650.00	0.19
83	603599	广信股份	9,900	291,060.00	0.19
84	600478	科力远	31,007	290,845.66	0.19
85	300633	开立医疗	5,300	290,599.00	0.19
86	002747	埃斯顿	13,300	288,344.00	0.18
87	600057	厦门象屿	28,000	287,560.00	0.18

88	600882	妙可蓝多	9,000	286,560.00	0.18
89	002318	久立特材	17,200	286,208.00	0.18
90	688066	航天宏图	3,336	285,228.00	0.18
91	002517	恺英网络	43,300	284,048.00	0.18
92	002558	巨人网络	35,600	283,376.00	0.18
93	600179	安通控股	85,900	282,611.00	0.18
94	603678	火炬电子	6,900	282,486.00	0.18
95	600110	诺德股份	35,500	282,225.00	0.18
96	300343	联创股份	28,900	281,775.00	0.18
97	300294	博雅生物	7,700	281,512.00	0.18
98	603179	新泉股份	7,300	280,977.00	0.18
99	002145	中核钛白	45,390	279,602.40	0.18
100	002597	金禾实业	8,600	279,500.00	0.18
101	300101	振芯科技	11,200	274,400.00	0.17
102	300803	指南针	6,000	274,320.00	0.17
103	002675	东诚药业	16,500	273,240.00	0.17
104	002456	欧菲光	57,900	272,709.00	0.17
105	002617	露笑科技	29,300	270,439.00	0.17
106	603129	春风动力	2,400	270,048.00	0.17
107	688202	美迪西	1,257	268,859.73	0.17
108	300432	富临精工	18,600	268,398.00	0.17
109	300748	金力永磁	9,100	266,266.00	0.17
110	002139	拓邦股份	25,600	265,472.00	0.17
111	688707	振华新材	5,885	264,530.75	0.17
112	300083	创世纪	31,200	264,264.00	0.17
113	300332	天壕环境	21,900	262,581.00	0.17
114	688617	惠泰医疗	850	260,890.50	0.17
115	600641	万业企业	14,700	260,631.00	0.17
116	603308	应流股份	12,200	259,860.00	0.17
117	002851	麦格米特	10,000	259,600.00	0.17
118	601678	滨化股份	50,500	259,570.00	0.17
119	002254	泰和新材	12,200	258,762.00	0.16
120	603876	鼎胜新材	6,300	258,552.00	0.16
121	600977	中国电影	19,000	258,400.00	0.16
122	002151	北斗星通	9,200	258,336.00	0.16
123	600100	同方股份	59,500	256,445.00	0.16
124	601375	中原证券	70,000	254,800.00	0.16
125	000034	神州数码	11,500	252,310.00	0.16
126	002015	协鑫能科	19,200	251,904.00	0.16
127	688023	安恒信息	1,272	251,856.00	0.16
128	601001	晋控煤业	21,000	251,160.00	0.16
129	300567	精测电子	5,000	251,000.00	0.16
130	002126	银轮股份	20,200	250,682.00	0.16

131	002706	良信股份	17,100	250,515.00	0.16
132	000403	派林生物	11,000	250,360.00	0.16
133	688333	铂力特	1,749	249,669.75	0.16
134	300451	创业慧康	31,300	247,583.00	0.16
135	300587	天铁股份	21,451	247,115.52	0.16
136	603005	晶方科技	13,300	246,715.00	0.16
137	300672	国科微	2,900	246,645.00	0.16
138	002324	普利特	15,300	244,800.00	0.16
139	002984	森麒麟	7,900	243,241.00	0.15
140	002063	远光软件	32,000	242,880.00	0.15
141	601567	三星医疗	17,900	241,292.00	0.15
142	688680	海优新材	1,299	240,704.70	0.15
143	300679	电连技术	6,500	240,500.00	0.15
144	601908	京运通	36,600	240,462.00	0.15
145	002727	一心堂	7,600	239,476.00	0.15
146	300525	博思软件	12,050	238,590.00	0.15
147	002182	云海金属	11,300	238,430.00	0.15
148	301071	力量钻石	2,000	238,300.00	0.15
149	603979	金诚信	9,200	235,612.00	0.15
150	300379	东方通	11,500	234,945.00	0.15
151	300036	超图软件	12,500	233,125.00	0.15
152	300065	海兰信	17,600	232,496.00	0.15
153	600123	兰花科创	17,400	232,116.00	0.15
154	002085	万丰奥威	38,900	231,455.00	0.15
155	603588	高能环境	23,240	228,681.60	0.15
156	601258	庞大集团	207,700	228,470.00	0.15
157	603306	华懋科技	6,100	228,201.00	0.15
158	300458	全志科技	11,200	228,032.00	0.15
159	300773	拉卡拉	13,500	227,880.00	0.15
160	000032	深桑达 A	11,300	227,695.00	0.15
161	600330	天通股份	21,600	227,664.00	0.14
162	000035	中国天楹	44,900	227,643.00	0.14
163	002332	仙琚制药	20,100	227,130.00	0.14
164	600773	西藏城投	12,500	226,875.00	0.14
165	300623	捷捷微电	11,000	226,820.00	0.14
166	600277	亿利洁能	54,200	226,556.00	0.14
167	600996	贵广网络	15,200	226,328.00	0.14
168	002832	比音勒芬	8,800	225,368.00	0.14
169	600323	瀚蓝环境	12,200	225,212.00	0.14
170	300573	兴齐眼药	1,800	225,144.00	0.14
171	002585	双星新材	17,600	224,400.00	0.14
172	300315	掌趣科技	69,500	223,095.00	0.14
173	000951	中国重汽	15,000	222,600.00	0.14

174	600063	皖维高新	38,000	222,300.00	0.14
175	300459	汤姆猫	70,500	222,075.00	0.14
176	688388	嘉元科技	4,949	221,962.65	0.14
177	300910	瑞丰新材	1,800	221,958.00	0.14
178	002446	盛路通信	23,200	221,792.00	0.14
179	600363	联创光电	9,300	221,433.00	0.14
180	002761	浙江建投	10,500	221,340.00	0.14
181	601399	国机重装	73,200	221,064.00	0.14
182	603063	禾望电气	7,900	220,252.00	0.14
183	600821	金开新能	30,400	220,096.00	0.14
184	603505	金石资源	5,540	219,494.80	0.14
185	600586	金晶科技	25,200	219,492.00	0.14
186	301047	义翘神州	2,200	219,252.00	0.14
187	603305	旭升集团	6,800	219,232.00	0.14
188	688700	东威科技	1,530	219,019.50	0.14
189	002807	江阴银行	55,100	218,747.00	0.14
190	000915	华特达因	4,800	218,400.00	0.14
191	301155	海力风电	2,500	218,375.00	0.14
192	603279	景津装备	7,400	218,152.00	0.14
193	688778	厦钨新能	2,800	217,504.00	0.14
194	688083	中望软件	1,117	217,345.86	0.14
195	000657	中钨高新	13,700	217,008.00	0.14
196	002079	苏州固锟	16,200	216,918.00	0.14
197	603690	至纯科技	5,700	215,688.00	0.14
198	600562	国睿科技	12,700	215,265.00	0.14
199	603128	华贸物流	20,000	214,800.00	0.14
200	688559	海目星	3,710	214,586.40	0.14
201	688017	绿的谐波	2,210	213,883.80	0.14
202	002258	利尔化学	11,900	213,724.00	0.14
203	002837	英维克	6,400	213,184.00	0.14
204	300077	国民技术	15,200	212,040.00	0.14
205	300827	上能电气	3,600	211,824.00	0.13
206	600685	中船防务	10,200	211,752.00	0.13
207	688608	恒玄科技	1,856	211,584.00	0.13
208	603565	中谷物流	14,528	211,237.12	0.13
209	688639	华恒生物	1,360	211,140.00	0.13
210	600452	涪陵电力	13,980	211,098.00	0.13
211	600916	中国黄金	16,700	211,088.00	0.13
212	002091	江苏国泰	24,800	210,800.00	0.13
213	600483	福能股份	19,900	210,542.00	0.13
214	688037	芯源微	1,336	209,084.00	0.13
215	002011	盾安环境	15,900	208,767.00	0.13
216	688520	神州细胞	3,444	208,706.40	0.13

217	688518	联赢激光	7,145	208,705.45	0.13
218	600273	嘉化能源	24,900	208,413.00	0.13
219	002643	万润股份	14,200	208,172.00	0.13
220	688711	宏微科技	2,240	207,872.00	0.13
221	600151	航天机电	25,500	207,825.00	0.13
222	300747	锐科激光	8,750	206,937.50	0.13
223	688408	中信博	2,099	206,541.60	0.13
224	603612	索通发展	7,900	205,558.00	0.13
225	002291	遥望科技	15,800	205,400.00	0.13
226	600055	万东医疗	10,500	205,170.00	0.13
227	000810	创维数字	14,700	204,918.00	0.13
228	002004	华邦健康	40,000	204,000.00	0.13
229	002216	三全食品	11,000	203,610.00	0.13
230	600877	声光电科	14,900	203,534.00	0.13
231	002839	张家港行	44,100	203,301.00	0.13
232	600116	三峡水利	23,600	202,252.00	0.13
233	002099	海翔药业	28,800	201,888.00	0.13
234	601369	陕鼓动力	17,600	201,696.00	0.13
235	002544	普天科技	12,000	201,480.00	0.13
236	688007	光峰科技	8,076	200,769.36	0.13
237	000049	德赛电池	4,600	200,008.00	0.13
238	600572	康恩贝	42,200	199,606.00	0.13
239	688276	百克生物	2,885	199,382.35	0.13
240	600908	无锡银行	37,800	199,206.00	0.13
241	603008	喜临门	6,900	196,995.00	0.13
242	601212	白银有色	75,200	195,520.00	0.12
243	300476	胜宏科技	15,100	195,394.00	0.12
244	002100	天康生物	23,500	195,285.00	0.12
245	600267	海正药业	17,700	195,054.00	0.12
246	300687	赛意信息	6,600	194,700.00	0.12
247	600037	歌华有线	23,900	194,546.00	0.12
248	600389	江山股份	4,400	193,952.00	0.12
249	600206	有研新材	15,100	193,884.00	0.12
250	601965	中国汽研	10,000	193,800.00	0.12
251	002960	青鸟消防	6,900	193,131.00	0.12
252	000982	中银绒业	108,200	192,596.00	0.12
253	300596	利安隆	3,500	190,995.00	0.12
254	600422	昆药集团	13,500	190,620.00	0.12
255	603348	文灿股份	3,300	189,981.00	0.12
256	300737	科顺股份	15,100	189,958.00	0.12
257	300185	通裕重工	79,100	189,840.00	0.12
258	300443	金雷股份	4,700	189,316.00	0.12
259	000902	新洋丰	16,400	188,764.00	0.12

260	603826	坤彩科技	3,600	188,676.00	0.12
261	300087	荃银高科	11,700	188,370.00	0.12
262	000503	国新健康	18,500	187,960.00	0.12
263	002020	京新药业	15,400	187,572.00	0.12
264	688033	天宜上佳	8,597	187,156.69	0.12
265	603529	爱玛科技	4,080	187,149.60	0.12
266	600305	恒顺醋业	15,200	187,112.00	0.12
267	000917	电广传媒	36,000	186,480.00	0.12
268	601860	紫金银行	72,000	186,480.00	0.12
269	605376	博迁新材	4,000	185,720.00	0.12
270	600252	中恒集团	70,600	185,678.00	0.12
271	002006	精功科技	7,400	185,000.00	0.12
272	300456	赛微电子	12,500	184,750.00	0.12
273	300627	华测导航	6,600	183,480.00	0.12
274	688016	心脉医疗	970	183,368.80	0.12
275	601208	东材科技	16,000	182,880.00	0.12
276	300685	艾德生物	6,900	182,505.00	0.12
277	300166	东方国信	22,800	182,172.00	0.12
278	002698	博实股份	13,000	182,130.00	0.12
279	000090	天健集团	33,300	181,818.00	0.12
280	300772	运达股份	12,200	181,414.00	0.12
281	600966	博汇纸业	20,400	181,356.00	0.12
282	688298	东方生物	2,350	181,208.50	0.12
283	601126	四方股份	12,400	181,040.00	0.12
284	300133	华策影视	33,900	180,687.00	0.12
285	300398	飞凯材料	10,500	180,285.00	0.11
286	300233	金城医药	7,900	179,883.00	0.11
287	688696	极米科技	1,082	179,828.40	0.11
288	002928	华夏航空	13,000	179,790.00	0.11
289	002123	梦网科技	16,000	179,680.00	0.11
290	600366	宁波韵升	17,000	179,350.00	0.11
291	601777	力帆科技	46,300	178,718.00	0.11
292	688019	安集科技	992	178,560.00	0.11
293	002041	登海种业	9,000	178,380.00	0.11
294	600459	贵研铂业	11,300	177,862.00	0.11
295	300855	图南股份	3,800	177,802.00	0.11
296	600577	精达股份	41,900	177,656.00	0.11
297	300767	震安科技	3,800	177,650.00	0.11
298	000829	天音控股	18,200	177,268.00	0.11
299	600850	电科数字	8,820	177,105.60	0.11
300	300075	数字政通	10,100	177,053.00	0.11
301	600740	山西焦化	32,600	176,366.00	0.11
302	002726	龙大美食	19,200	176,064.00	0.11

303	000650	仁和药业	28,400	175,796.00	0.11
304	002467	二六三	35,200	174,944.00	0.11
305	300457	赢合科技	9,900	174,933.00	0.11
306	002171	楚江新材	23,700	174,195.00	0.11
307	600993	马应龙	7,700	174,020.00	0.11
308	002737	葵花药业	7,500	173,850.00	0.11
309	600761	安徽合力	13,200	173,580.00	0.11
310	000426	兴业矿业	28,500	173,565.00	0.11
311	600688	上海石化	55,800	173,538.00	0.11
312	002567	唐人神	24,500	173,460.00	0.11
313	300079	数码视讯	36,200	173,398.00	0.11
314	601137	博威合金	11,700	173,277.00	0.11
315	605123	派克新材	1,300	172,770.00	0.11
316	300726	宏达电子	3,900	172,146.00	0.11
317	600197	伊力特	7,000	171,780.00	0.11
318	300662	科锐国际	3,500	171,500.00	0.11
319	300674	宇信科技	12,200	171,410.00	0.11
320	600869	远东股份	33,900	171,195.00	0.11
321	603212	赛伍技术	5,400	171,180.00	0.11
322	603300	华铁应急	27,000	171,180.00	0.11
323	000681	视觉中国	13,900	170,970.00	0.11
324	300170	汉得信息	21,000	170,940.00	0.11
325	603323	苏农银行	36,400	170,716.00	0.11
326	300409	道氏技术	11,600	170,404.00	0.11
327	600158	中体产业	19,500	170,235.00	0.11
328	002539	云图控股	15,300	170,136.00	0.11
329	002163	海南发展	14,900	170,009.00	0.11
330	603997	继峰股份	11,100	169,608.00	0.11
331	688133	泰坦科技	1,224	169,487.28	0.11
332	002261	拓维信息	25,500	169,065.00	0.11
333	300655	晶瑞电材	11,500	168,820.00	0.11
334	600557	康缘药业	9,000	168,750.00	0.11
335	600888	新疆众和	20,600	168,714.00	0.11
336	002174	游族网络	18,200	168,532.00	0.11
337	000546	金圆股份	13,900	168,468.00	0.11
338	600610	中毅达	10,600	168,222.00	0.11
339	600491	龙元建设	26,700	167,943.00	0.11
340	600986	浙文互联	33,600	167,664.00	0.11
341	601952	苏垦农发	14,100	166,944.00	0.11
342	603032	德新科技	1,900	166,744.00	0.11
343	603906	龙蟠科技	7,200	166,680.00	0.11
344	000582	北部湾港	22,500	166,275.00	0.11
345	000758	中色股份	35,000	166,250.00	0.11

346	000059	华锦股份	24,400	165,920.00	0.11
347	600578	京能电力	51,000	165,750.00	0.11
348	600933	爱柯迪	9,100	165,711.00	0.11
349	601918	新集能源	39,500	165,505.00	0.11
350	002390	信邦制药	35,200	165,440.00	0.11
351	000735	罗牛山	23,400	165,438.00	0.11
352	002130	沃尔核材	25,600	165,120.00	0.11
353	000682	东方电子	20,500	164,820.00	0.10
354	600446	金证股份	16,000	164,640.00	0.10
355	688321	微芯生物	7,490	164,630.20	0.10
356	300109	新开源	6,800	164,560.00	0.10
357	600328	中盐化工	11,200	164,528.00	0.10
358	600621	华鑫股份	15,900	164,247.00	0.10
359	600246	万通发展	26,100	164,169.00	0.10
360	003031	中瓷电子	1,700	163,710.00	0.10
361	300470	中密控股	4,200	163,422.00	0.10
362	002906	华阳集团	4,900	162,778.00	0.10
363	301069	凯盛新材	5,900	162,722.00	0.10
364	600320	振华重工	50,600	162,426.00	0.10
365	603595	东尼电子	2,700	162,351.00	0.10
366	002626	金达威	7,800	161,616.00	0.10
367	600645	中源协和	9,500	161,595.00	0.10
368	600496	精工钢构	40,900	161,555.00	0.10
369	300762	上海瀚讯	12,220	161,059.60	0.10
370	600295	鄂尔多斯	10,600	161,014.00	0.10
371	603197	保隆科技	3,400	160,820.00	0.10
372	600428	中远海特	26,900	160,324.00	0.10
373	002537	海联金汇	20,900	160,303.00	0.10
374	300671	富满微	3,900	159,393.00	0.10
375	600266	城建发展	34,200	159,030.00	0.10
376	002895	川恒股份	6,100	159,027.00	0.10
377	600312	平高电气	20,100	158,991.00	0.10
378	000627	天茂集团	50,200	158,632.00	0.10
379	600587	新华医疗	7,400	158,508.00	0.10
380	603733	仙鹤股份	5,200	158,444.00	0.10
381	000767	晋控电力	46,500	157,635.00	0.10
382	002214	大立科技	12,000	157,440.00	0.10
383	300323	华灿光电	24,300	156,735.00	0.10
384	002649	博彦科技	15,100	155,379.00	0.10
385	300224	正海磁材	12,400	155,372.00	0.10
386	600720	祁连山	15,600	154,908.00	0.10
387	688266	泽璟制药	3,712	154,790.40	0.10
388	600059	古越龙山	15,900	154,389.00	0.10

389	688425	铁建重工	39,080	154,366.00	0.10
390	300598	诚迈科技	3,300	154,308.00	0.10
391	600210	紫江企业	30,800	154,000.00	0.10
392	600811	东方集团	63,100	153,964.00	0.10
393	300973	立高食品	1,600	153,888.00	0.10
394	002237	恒邦股份	14,600	153,884.00	0.10
395	002003	伟星股份	15,200	153,824.00	0.10
396	000685	中山公用	21,800	153,254.00	0.10
397	300188	美亚柏科	11,900	153,034.00	0.10
398	600248	陕西建工	36,400	152,880.00	0.10
399	300158	振东制药	20,500	152,725.00	0.10
400	600797	浙大网新	26,100	152,685.00	0.10
401	002612	朗姿股份	5,500	152,680.00	0.10
402	600682	南京新百	16,700	152,471.00	0.10
403	688339	亿华通	2,060	152,440.00	0.10
404	002276	万马股份	18,400	151,800.00	0.10
405	300348	长亮科技	14,900	151,682.00	0.10
406	301219	腾远钴业	2,200	151,646.00	0.10
407	002400	省广集团	35,400	151,512.00	0.10
408	000488	晨鸣纸业	30,400	151,392.00	0.10
409	000006	深振业 A	24,000	151,200.00	0.10
410	002413	雷科防务	34,200	151,164.00	0.10
411	300382	斯莱克	8,000	151,040.00	0.10
412	301238	瑞泰新材	6,700	150,683.00	0.10
413	002038	双鹭药业	18,300	150,426.00	0.10
414	300236	上海新阳	5,400	150,066.00	0.10
415	002061	浙江交科	28,300	149,990.00	0.10
416	300039	上海凯宝	18,600	149,916.00	0.10
417	603298	杭叉集团	8,900	149,609.00	0.10
418	600120	浙江东方	41,900	149,583.00	0.10
419	603098	森特股份	5,300	149,566.00	0.10
420	300171	东富龙	6,300	149,499.00	0.10
421	002233	塔牌集团	21,000	149,100.00	0.09
422	601519	大智慧	25,900	148,925.00	0.09
423	300613	富瀚微	2,970	148,886.10	0.09
424	300229	拓尔思	12,700	148,844.00	0.09
425	000921	海信家电	11,300	148,821.00	0.09
426	600963	岳阳林纸	27,300	148,785.00	0.09
427	300151	昌红科技	7,700	148,687.00	0.09
428	000923	河钢资源	11,300	148,595.00	0.09
429	300428	立中集团	6,000	148,500.00	0.09
430	601890	亚星锚链	16,700	147,461.00	0.09
431	688131	皓元医药	1,360	147,396.80	0.09

432	600098	广州发展	26,500	147,075.00	0.09
433	300394	天孚通信	5,800	147,030.00	0.09
434	300226	上海钢联	5,300	146,863.00	0.09
435	301031	中熔电气	900	146,691.00	0.09
436	601200	上海环境	16,400	146,452.00	0.09
437	600502	安徽建工	30,500	146,400.00	0.09
438	002349	精华制药	12,100	146,168.00	0.09
439	601311	骆驼股份	17,900	146,064.00	0.09
440	600285	羚锐制药	11,200	146,048.00	0.09
441	300369	绿盟科技	14,300	146,003.00	0.09
442	600717	天津港	35,500	145,550.00	0.09
443	688575	亚辉龙	7,405	145,508.25	0.09
444	600477	杭萧钢构	35,900	145,395.00	0.09
445	600635	大众公用	49,100	145,336.00	0.09
446	002556	辉隆股份	16,600	145,250.00	0.09
447	300497	富祥药业	11,000	145,200.00	0.09
448	000712	锦龙股份	11,200	144,928.00	0.09
449	002239	奥特佳	57,700	144,250.00	0.09
450	300638	广和通	8,050	144,095.00	0.09
451	300841	康华生物	1,700	143,854.00	0.09
452	688106	金宏气体	7,659	143,682.84	0.09
453	603363	傲农生物	11,100	143,079.00	0.09
454	000528	柳 工	24,300	142,884.00	0.09
455	600075	新疆天业	26,100	142,767.00	0.09
456	600675	中华企业	46,300	142,604.00	0.09
457	000851	高鸿股份	29,600	142,376.00	0.09
458	002550	千红制药	22,700	142,102.00	0.09
459	603043	广州酒家	5,500	142,010.00	0.09
460	000969	安泰科技	18,300	141,825.00	0.09
461	002498	汉缆股份	33,900	141,702.00	0.09
462	603393	新天然气	6,500	141,505.00	0.09
463	002217	合力泰	55,400	141,270.00	0.09
464	002859	洁美科技	5,000	141,150.00	0.09
465	300401	花园生物	9,800	141,022.00	0.09
466	002847	盐津铺子	1,300	140,777.00	0.09
467	000688	国城矿业	8,600	139,406.00	0.09
468	600602	云赛智联	16,000	139,360.00	0.09
469	002222	福晶科技	8,800	139,216.00	0.09
470	600750	江中药业	9,600	138,720.00	0.09
471	002453	华软科技	13,200	138,600.00	0.09
472	600770	综艺股份	19,900	138,504.00	0.09
473	300180	华峰超纤	35,800	138,188.00	0.09
474	603368	柳药集团	7,400	138,158.00	0.09

475	600223	鲁商发展	13,000	137,670.00	0.09
476	600812	华北制药	21,500	137,600.00	0.09
477	300027	华谊兄弟	49,300	137,054.00	0.09
478	600612	老凤祥	3,200	136,960.00	0.09
479	603728	鸣志电器	4,100	136,653.00	0.09
480	000848	承德露露	16,100	136,528.00	0.09
481	603123	翠微股份	9,600	136,224.00	0.09
482	000727	冠捷科技	69,000	135,930.00	0.09
483	300131	英唐智控	28,000	135,240.00	0.09
484	002773	康弘药业	8,600	134,934.00	0.09
485	000555	神州信息	12,500	134,625.00	0.09
486	688198	佰仁医疗	1,042	134,418.00	0.09
487	002421	达实智能	38,800	134,248.00	0.09
488	300303	聚飞光电	34,200	134,064.00	0.09
489	600552	凯盛科技	14,500	133,980.00	0.09
490	002581	未名医药	8,500	133,875.00	0.09
491	603919	金徽酒	5,000	133,750.00	0.09
492	603187	海容冷链	4,200	133,224.00	0.08
493	601028	玉龙股份	11,600	133,168.00	0.08
494	300639	凯普生物	7,900	133,115.00	0.08
495	605507	国邦医药	5,000	132,350.00	0.08
496	300770	新媒股份	3,500	131,810.00	0.08
497	002234	民和股份	6,800	131,512.00	0.08
498	300326	凯利泰	18,200	131,040.00	0.08
499	603985	恒润股份	5,300	130,910.00	0.08
500	002639	雪人股份	15,400	130,900.00	0.08
501	601963	重庆银行	19,300	130,854.00	0.08
502	600789	鲁抗医药	18,000	130,680.00	0.08
503	300799	左江科技	1,000	130,360.00	0.08
504	000672	上峰水泥	12,200	130,296.00	0.08
505	600072	中船科技	10,900	129,710.00	0.08
506	600073	上海梅林	16,300	129,585.00	0.08
507	603301	振德医疗	3,400	129,370.00	0.08
508	000603	盛达资源	10,300	129,368.00	0.08
509	000913	钱江摩托	7,000	129,360.00	0.08
510	600360	华微电子	19,600	129,164.00	0.08
511	000543	皖能电力	28,800	129,024.00	0.08
512	603801	志邦家居	4,800	129,024.00	0.08
513	300055	万邦达	16,000	128,960.00	0.08
514	000615	奥园美谷	15,600	128,856.00	0.08
515	688027	国盾量子	1,264	128,738.40	0.08
516	000927	中国铁物	46,100	128,619.00	0.08
517	603018	华设集团	16,900	128,102.00	0.08

518	000016	深康佳 A	28,400	128,084.00	0.08
519	002201	正威新材	9,920	127,968.00	0.08
520	688686	奥普特	963	127,116.00	0.08
521	600649	城投控股	31,900	126,962.00	0.08
522	002158	汉钟精机	5,300	126,935.00	0.08
523	002440	闰土股份	17,500	126,875.00	0.08
524	603766	隆鑫通用	26,100	126,846.00	0.08
525	002545	东方铁塔	15,300	126,837.00	0.08
526	600125	铁龙物流	23,200	126,672.00	0.08
527	300119	瑞普生物	6,800	126,548.00	0.08
528	002023	海特高新	15,300	126,531.00	0.08
529	688166	博瑞医药	5,598	126,346.86	0.08
530	600742	一汽富维	15,100	126,236.00	0.08
531	002589	瑞康医药	30,600	126,072.00	0.08
532	605090	九丰能源	6,100	125,965.00	0.08
533	300287	飞利信	36,300	125,961.00	0.08
534	000539	粤电力 A	22,600	125,430.00	0.08
535	000718	苏宁环球	38,000	125,400.00	0.08
536	603583	捷昌驱动	4,900	125,244.00	0.08
537	688356	键凯科技	800	125,240.00	0.08
538	603636	南威软件	9,100	125,034.00	0.08
539	002043	兔宝宝	11,500	124,890.00	0.08
540	603396	金辰股份	1,500	124,860.00	0.08
541	603936	博敏电子	10,200	124,644.00	0.08
542	300355	蒙草生态	40,700	124,542.00	0.08
543	600172	黄河旋风	25,700	124,388.00	0.08
544	600108	亚盛集团	39,600	124,344.00	0.08
545	000811	冰轮环境	11,200	124,320.00	0.08
546	300377	赢时胜	15,100	123,971.00	0.08
547	002428	云南锗业	13,300	123,956.00	0.08
548	600864	哈投股份	26,300	123,610.00	0.08
549	002488	金固股份	20,400	123,216.00	0.08
550	603566	普莱柯	4,500	123,120.00	0.08
551	002206	海利得	20,600	122,982.00	0.08
552	300663	科蓝软件	9,400	122,952.00	0.08
553	603896	寿仙谷	3,100	122,946.00	0.08
554	300406	九强生物	7,500	122,775.00	0.08
555	300653	正海生物	2,850	122,550.00	0.08
556	688278	特宝生物	3,146	122,473.78	0.08
557	600169	太原重工	51,400	122,332.00	0.08
558	000036	华联控股	30,200	122,310.00	0.08
559	000966	长源电力	26,300	121,769.00	0.08
560	002741	光华科技	6,700	120,935.00	0.08

561	002746	仙坛股份	13,200	120,912.00	0.08
562	688499	利元亨	765	120,395.70	0.08
563	300352	北信源	29,400	119,952.00	0.08
564	300761	立华股份	3,500	119,875.00	0.08
565	002190	成飞集成	4,600	119,830.00	0.08
566	000935	四川双马	5,700	119,700.00	0.08
567	300232	洲明科技	21,800	119,682.00	0.08
568	603995	甬金股份	4,300	119,669.00	0.08
569	300696	爱乐达	4,500	119,385.00	0.08
570	600420	国药现代	13,100	119,210.00	0.08
571	002967	广电计量	7,100	119,138.00	0.08
572	688676	金盘科技	3,280	118,670.40	0.08
573	300319	麦捷科技	15,200	118,256.00	0.08
574	600729	重庆百货	5,000	118,250.00	0.08
575	600490	鹏欣资源	39,400	118,200.00	0.08
576	000976	华铁股份	32,200	118,174.00	0.08
577	000676	智度股份	22,300	117,967.00	0.08
578	002293	罗莱生活	10,500	117,810.00	0.08
579	688568	中科星图	1,896	117,627.84	0.07
580	002108	沧州明珠	25,500	117,555.00	0.07
581	601528	瑞丰银行	18,600	117,366.00	0.07
582	002697	红旗连锁	20,800	117,104.00	0.07
583	000901	航天科技	14,300	116,688.00	0.07
584	601619	嘉泽新能	30,900	116,493.00	0.07
585	300102	乾照光电	18,400	116,288.00	0.07
586	601011	宝泰隆	33,500	116,245.00	0.07
587	300031	宝通科技	8,400	116,172.00	0.07
588	002218	拓日新能	24,000	115,920.00	0.07
589	000088	盐田港	22,800	115,596.00	0.07
590	000989	九芝堂	13,100	115,411.00	0.07
591	600523	贵航股份	5,900	115,286.00	0.07
592	601702	华峰铝业	7,700	115,115.00	0.07
593	688158	优刻得	9,187	114,929.37	0.07
594	002351	漫步者	12,900	114,552.00	0.07
595	300366	创意信息	11,900	114,478.00	0.07
596	002310	东方园林	54,500	114,450.00	0.07
597	600643	爱建集团	20,700	114,264.00	0.07
598	300208	青岛中程	11,200	114,240.00	0.07
599	688578	艾力斯	5,800	114,144.00	0.07
600	600284	浦东建设	16,900	113,906.00	0.07
601	601929	吉视传媒	58,700	113,878.00	0.07
602	603105	芯能科技	7,700	113,421.00	0.07
603	002481	双塔食品	18,100	113,306.00	0.07

604	002088	鲁阳节能	4,900	113,288.00	0.07
605	600480	凌云股份	13,300	113,183.00	0.07
606	600531	豫光金铅	21,700	113,057.00	0.07
607	300263	隆华科技	15,900	112,572.00	0.07
608	000795	英洛华	17,300	112,277.00	0.07
609	600955	维远股份	5,400	112,158.00	0.07
610	002810	山东赫达	5,000	112,100.00	0.07
611	300271	华宇软件	16,400	112,012.00	0.07
612	002759	天际股份	6,900	111,987.00	0.07
613	000028	国药一致	3,400	111,826.00	0.07
614	600211	西藏药业	3,100	111,352.00	0.07
615	000612	焦作万方	21,300	111,186.00	0.07
616	300267	尔康制药	31,300	111,115.00	0.07
617	002106	莱宝高科	14,400	110,592.00	0.07
618	600017	日照港	39,100	110,262.00	0.07
619	600657	信达地产	21,400	109,996.00	0.07
620	300900	广联航空	3,800	109,174.00	0.07
621	603609	禾丰股份	9,200	108,928.00	0.07
622	002635	安洁科技	8,800	108,680.00	0.07
623	688508	芯朋微	1,675	108,556.75	0.07
624	002135	东南网架	17,400	108,402.00	0.07
625	300477	合纵科技	21,400	108,284.00	0.07
626	600395	盘江股份	16,100	108,192.00	0.07
627	300007	汉威科技	6,400	108,160.00	0.07
628	600995	南网储能	7,500	108,150.00	0.07
629	600971	恒源煤电	15,100	108,116.00	0.07
630	600776	东方通信	11,800	108,088.00	0.07
631	300284	苏交科	19,300	108,080.00	0.07
632	000557	西部创业	22,000	107,800.00	0.07
633	002194	武汉凡谷	11,700	107,757.00	0.07
634	300358	楚天科技	7,300	107,675.00	0.07
635	002930	宏川智慧	5,600	107,520.00	0.07
636	300821	东岳硅材	9,200	107,456.00	0.07
637	002645	华宏科技	7,200	107,352.00	0.07
638	000498	山东路桥	15,600	107,172.00	0.07
639	600997	开滦股份	15,800	107,124.00	0.07
640	002646	天佑德酒	7,000	107,100.00	0.07
641	603489	八方股份	1,000	106,990.00	0.07
642	605168	三人行	1,200	106,764.00	0.07
643	600751	海航科技	45,800	106,714.00	0.07
644	300659	中孚信息	4,000	106,680.00	0.07
645	002274	华昌化工	14,600	106,434.00	0.07
646	002987	京北方	4,000	106,360.00	0.07

647	002979	雷赛智能	4,700	106,267.00	0.07
648	300709	精研科技	3,760	105,994.40	0.07
649	300123	亚光科技	17,900	105,789.00	0.07
650	000801	四川九洲	16,200	105,624.00	0.07
651	000065	北方国际	12,800	105,600.00	0.07
652	000652	泰达股份	26,200	105,586.00	0.07
653	002314	南山控股	27,600	105,432.00	0.07
654	300738	奥飞数据	11,960	105,367.60	0.07
655	603989	艾华集团	4,100	105,288.00	0.07
656	000968	蓝焰控股	12,100	105,149.00	0.07
657	600984	建设机械	19,230	104,995.80	0.07
658	601882	海天精工	4,000	104,800.00	0.07
659	002449	国星光电	12,600	104,706.00	0.07
660	600103	青山纸业	46,400	104,400.00	0.07
661	000560	我爱我家	41,700	104,250.00	0.07
662	600163	中闽能源	19,400	104,178.00	0.07
663	688776	国光电气	595	104,172.60	0.07
664	603010	万盛股份	8,800	104,104.00	0.07
665	300149	睿智医药	10,000	104,100.00	0.07
666	600775	南京熊猫	10,000	104,100.00	0.07
667	001696	宗申动力	17,500	103,950.00	0.07
668	300723	一品红	3,000	103,740.00	0.07
669	600331	宏达股份	36,100	103,607.00	0.07
670	002777	久远银海	6,900	103,500.00	0.07
671	600810	神马股份	13,300	103,341.00	0.07
672	600217	中再资环	20,900	102,828.00	0.07
673	002549	凯美特气	6,800	102,748.00	0.07
674	688789	宏华数科	595	102,714.85	0.07
675	603959	百利科技	9,700	102,529.00	0.07
676	000789	万年青	12,000	102,480.00	0.07
677	002204	大连重工	19,700	102,243.00	0.07
678	603520	司太立	5,220	102,155.40	0.07
679	603915	国茂股份	4,900	102,116.00	0.07
680	601609	金田股份	15,100	102,076.00	0.07
681	002292	奥飞娱乐	21,900	102,054.00	0.06
682	603033	三维股份	5,910	102,006.60	0.06
683	002285	世联行	31,000	101,990.00	0.06
684	603171	税友股份	2,800	101,920.00	0.06
685	300184	力源信息	23,700	101,910.00	0.06
686	600508	上海能源	7,100	101,743.00	0.06
687	603666	亿嘉和	3,200	101,728.00	0.06
688	002055	得润电子	11,800	101,716.00	0.06
689	600662	外服控股	17,000	101,490.00	0.06

690	002489	浙江永强	27,700	101,382.00	0.06
691	002573	清新环境	18,200	101,192.00	0.06
692	002614	奥佳华	10,800	100,764.00	0.06
693	600876	洛阳玻璃	5,000	100,200.00	0.06
694	603416	信捷电气	2,200	99,704.00	0.06
695	300143	盈康生命	9,800	99,666.00	0.06
696	600391	航发科技	5,600	99,512.00	0.06
697	002437	誉衡药业	39,100	99,314.00	0.06
698	002226	江南化工	20,200	98,980.00	0.06
699	002307	北新路桥	19,200	98,880.00	0.06
700	603881	数据港	4,200	98,826.00	0.06
701	300755	华致酒行	3,200	98,784.00	0.06
702	002768	国恩股份	3,400	98,668.00	0.06
703	300222	科大智能	15,500	98,425.00	0.06
704	603169	兰石重装	15,500	98,270.00	0.06
705	603466	风语筑	7,250	98,092.50	0.06
706	688148	芳源股份	6,715	97,971.85	0.06
707	603387	基蛋生物	7,836	97,950.00	0.06
708	600308	华泰股份	19,300	97,851.00	0.06
709	002733	雄韬股份	5,700	97,755.00	0.06
710	603229	奥翔药业	4,100	97,580.00	0.06
711	688798	艾为电子	1,020	97,440.60	0.06
712	002283	天润工业	20,300	97,034.00	0.06
713	000061	农产品	17,000	96,900.00	0.06
714	002051	中工国际	12,300	96,801.00	0.06
715	601606	长城军工	9,300	96,720.00	0.06
716	600639	浦东金桥	8,700	96,570.00	0.06
717	600990	四创电子	3,240	96,552.00	0.06
718	603113	金能科技	10,600	96,142.00	0.06
719	300894	火星人	3,800	96,064.00	0.06
720	688733	壹石通	2,550	96,058.50	0.06
721	000567	海德股份	6,900	96,048.00	0.06
722	002097	山河智能	16,300	96,007.00	0.06
723	300657	弘信电子	8,720	95,832.80	0.06
724	301039	中集车辆	12,000	95,640.00	0.06
725	002034	旺能环境	5,300	95,612.00	0.06
726	000600	建投能源	18,200	95,550.00	0.06
727	300397	天和防务	10,300	95,378.00	0.06
728	600575	淮河能源	39,500	95,195.00	0.06
729	605369	拱东医疗	900	95,049.00	0.06
730	688586	江航装备	5,828	94,996.40	0.06
731	002251	步步高	13,200	94,908.00	0.06
732	600691	阳煤化工	30,200	94,828.00	0.06

733	601015	陕西黑猫	20,800	94,432.00	0.06
734	002950	奥美医疗	7,700	94,325.00	0.06
735	600783	鲁信创投	7,600	94,316.00	0.06
736	000928	中钢国际	16,000	94,080.00	0.06
737	300856	科思股份	1,800	93,870.00	0.06
738	002243	力合科创	12,100	93,412.00	0.06
739	000828	东莞控股	10,400	93,288.00	0.06
740	300177	中海达	15,200	93,176.00	0.06
741	603118	共进股份	11,700	93,015.00	0.06
742	002425	凯撒文化	19,500	92,625.00	0.06
743	600746	江苏索普	11,400	92,568.00	0.06
744	000597	东北制药	14,600	92,126.00	0.06
745	600458	时代新材	10,200	92,004.00	0.06
746	003012	东鹏控股	11,700	91,962.00	0.06
747	002320	海峡股份	16,700	91,850.00	0.06
748	300607	拓斯达	6,300	91,665.00	0.06
749	002516	旷达科技	18,700	91,630.00	0.06
750	002302	西部建设	12,600	91,350.00	0.06
751	688018	乐鑫科技	1,010	91,051.50	0.06
752	000048	京基智农	5,100	91,035.00	0.06
753	600114	东睦股份	10,700	90,950.00	0.06
754	300953	震裕科技	1,100	90,915.00	0.06
755	002215	诺普信	17,200	90,644.00	0.06
756	300130	新国都	7,500	90,525.00	0.06
757	000881	中广核技	11,700	90,441.00	0.06
758	300702	天宇股份	3,540	90,340.80	0.06
759	603060	国检集团	7,000	90,300.00	0.06
760	603108	润达医疗	8,900	89,979.00	0.06
761	000950	重药控股	17,700	89,916.00	0.06
762	000507	珠海港	16,000	89,760.00	0.06
763	002611	东方精工	22,000	89,320.00	0.06
764	603025	大豪科技	4,700	89,300.00	0.06
765	300266	兴源环境	27,900	89,280.00	0.06
766	688100	威胜信息	3,866	89,265.94	0.06
767	000903	云内动力	35,000	89,250.00	0.06
768	002367	康力电梯	11,900	89,250.00	0.06
769	688383	新益昌	940	89,187.20	0.06
770	002803	吉宏股份	5,600	88,704.00	0.06
771	600058	五矿发展	10,300	88,683.00	0.06
772	001213	中铁特货	20,500	88,560.00	0.06
773	600604	市北高新	17,900	88,426.00	0.06
774	000823	超声电子	9,500	88,255.00	0.06
775	002461	珠江啤酒	11,000	88,110.00	0.06

776	600929	雪天盐业	11,000	88,110.00	0.06
777	603429	集友股份	8,080	87,910.40	0.06
778	300740	水羊股份	5,800	87,696.00	0.06
779	300735	光弘科技	9,800	87,024.00	0.06
780	600550	保变电气	18,700	86,955.00	0.06
781	002017	东信和平	6,600	86,790.00	0.06
782	301217	铜冠铜箔	7,000	86,730.00	0.06
783	601686	友发集团	14,600	86,724.00	0.06
784	601886	江河集团	11,200	86,688.00	0.06
785	300792	壹网壹创	3,100	86,490.00	0.06
786	002929	润建股份	2,200	86,372.00	0.06
787	603208	江山欧派	1,400	85,960.00	0.05
788	301015	百洋医药	3,600	85,824.00	0.05
789	603567	珍宝岛	6,700	85,425.00	0.05
790	300206	理邦仪器	7,100	85,413.00	0.05
791	600105	永鼎股份	25,000	85,250.00	0.05
792	300205	天喻信息	7,700	84,700.00	0.05
793	300085	银之杰	9,100	84,630.00	0.05
794	600696	岩石股份	3,400	84,592.00	0.05
795	000566	海南海药	19,800	84,546.00	0.05
796	002782	可立克	4,900	84,378.00	0.05
797	301060	兰卫医学	4,300	84,323.00	0.05
798	688233	神工股份	2,062	84,129.60	0.05
799	300191	潜能恒信	4,900	84,035.00	0.05
800	300634	彩讯股份	5,500	83,875.00	0.05
801	000813	德展健康	22,600	83,846.00	0.05
802	600335	国机汽车	10,800	83,808.00	0.05
803	603916	苏博特	5,200	83,616.00	0.05
804	300423	昇辉科技	8,900	83,037.00	0.05
805	605009	豪悦护理	1,600	82,992.00	0.05
806	601588	北辰实业	40,500	82,620.00	0.05
807	002891	中宠股份	3,700	82,547.00	0.05
808	605338	巴比食品	2,600	82,498.00	0.05
809	603328	依顿电子	12,700	82,423.00	0.05
810	601827	三峰环境	12,800	82,304.00	0.05
811	600565	迪马股份	38,000	82,080.00	0.05
812	300579	数字认证	3,400	82,042.00	0.05
813	003040	楚天龙	4,700	81,968.00	0.05
814	600449	宁夏建材	6,900	81,903.00	0.05
815	300768	迪普科技	6,200	81,592.00	0.05
816	603601	再升科技	15,440	81,523.20	0.05
817	002838	道恩股份	4,600	81,328.00	0.05
818	688085	三友医疗	2,911	80,780.25	0.05

819	688526	科前生物	3,605	80,752.00	0.05
820	300091	金通灵	22,700	80,585.00	0.05
821	603718	海利生物	8,200	80,524.00	0.05
822	600748	上实发展	23,400	80,496.00	0.05
823	300204	舒泰神	5,900	80,240.00	0.05
824	603299	苏盐井神	8,000	79,760.00	0.05
825	601069	西部黄金	6,700	79,663.00	0.05
826	002534	西子洁能	5,500	79,640.00	0.05
827	000958	电投产融	17,800	79,388.00	0.05
828	603938	三孚股份	2,300	79,350.00	0.05
829	002267	陕天然气	11,000	79,310.00	0.05
830	600007	中国国贸	5,000	79,150.00	0.05
831	605222	起帆电缆	2,900	78,996.00	0.05
832	688660	电气风电	13,125	78,881.25	0.05
833	000030	富奥股份	17,900	78,760.00	0.05
834	688277	天智航	6,621	78,723.69	0.05
835	002833	弘亚数控	6,380	78,665.40	0.05
836	600581	八一钢铁	19,800	78,408.00	0.05
837	603533	掌阅科技	5,400	78,246.00	0.05
838	300527	中船应急	11,800	78,234.00	0.05
839	600710	苏美达	13,300	78,204.00	0.05
840	688366	昊海生科	800	78,032.00	0.05
841	300114	中航电测	7,600	77,976.00	0.05
842	601515	东风股份	18,080	77,744.00	0.05
843	688389	普门科技	4,353	77,613.99	0.05
844	600835	上海机电	6,900	77,418.00	0.05
845	002941	新疆交建	6,300	77,364.00	0.05
846	603730	岱美股份	4,800	77,184.00	0.05
847	300080	易成新能	16,500	76,890.00	0.05
848	002042	华孚时尚	25,000	76,250.00	0.05
849	000601	韶能股份	16,200	76,140.00	0.05
850	300846	首都在线	7,800	75,894.00	0.05
851	600590	泰豪科技	13,000	75,530.00	0.05
852	002918	蒙娜丽莎	4,200	75,516.00	0.05
853	601921	浙版传媒	10,200	75,480.00	0.05
854	002662	京威股份	22,900	75,341.00	0.05
855	002815	崇达技术	7,600	75,316.00	0.05
856	300134	大富科技	9,700	75,272.00	0.05
857	002344	海宁皮城	16,000	75,040.00	0.05
858	603920	世运电路	5,200	74,776.00	0.05
859	603313	梦百合	7,000	74,200.00	0.05
860	300765	新诺威	4,700	74,166.00	0.05
861	301175	中科环保	12,100	73,447.00	0.05

862	000791	甘肃电投	13,900	73,392.00	0.05
863	002435	长江健康	15,700	73,319.00	0.05
864	001270	铖昌科技	600	73,200.00	0.05
865	600874	创业环保	12,000	73,080.00	0.05
866	002959	小熊电器	1,200	72,384.00	0.05
867	300602	飞荣达	5,000	71,950.00	0.05
868	300842	帝科股份	1,400	71,946.00	0.05
869	300485	赛升药业	6,000	71,880.00	0.05
870	000517	荣安地产	24,300	71,685.00	0.05
871	000910	大亚圣象	8,400	71,568.00	0.05
872	300867	圣元环保	4,200	71,526.00	0.05
873	001258	立新能源	6,800	71,128.00	0.05
874	688399	硕世生物	810	71,045.10	0.05
875	603960	克来机电	4,000	70,920.00	0.05
876	002677	浙江美大	6,400	70,912.00	0.05
877	003032	传智教育	4,100	70,766.00	0.05
878	300328	宜安科技	11,800	70,564.00	0.04
879	300276	三丰智能	21,100	70,474.00	0.04
880	603337	杰克股份	3,700	70,448.00	0.04
881	002605	姚记科技	5,000	70,250.00	0.04
882	002978	安宁股份	2,100	70,056.00	0.04
883	300791	仙乐健康	1,900	69,863.00	0.04
884	601700	风范股份	13,600	69,496.00	0.04
885	600184	光电股份	6,200	69,440.00	0.04
886	002695	煌上煌	5,000	69,400.00	0.04
887	601949	中国出版	13,900	69,361.00	0.04
888	600400	红豆股份	16,800	69,216.00	0.04
889	002378	章源钨业	9,800	68,992.00	0.04
890	300783	三只松鼠	3,200	68,704.00	0.04
891	002991	甘源食品	900	68,661.00	0.04
892	600510	黑牡丹	10,400	68,640.00	0.04
893	000025	特力A	4,000	68,600.00	0.04
894	000550	江铃汽车	5,100	68,493.00	0.04
895	000710	贝瑞基因	6,000	68,460.00	0.04
896	300455	康拓红外	9,200	68,172.00	0.04
897	002993	奥海科技	2,000	68,020.00	0.04
898	688268	华特气体	916	68,013.00	0.04
899	000737	北方铜业	13,200	67,848.00	0.04
900	601330	绿色动力	10,000	67,700.00	0.04
901	300183	东软载波	5,600	67,480.00	0.04
902	688315	诺禾致源	2,550	67,294.50	0.04
903	300439	美康生物	5,700	66,690.00	0.04
904	603877	太平鸟	3,600	66,204.00	0.04

905	605388	均瑶健康	4,400	66,176.00	0.04
906	688127	蓝特光学	4,154	66,173.22	0.04
907	002664	信质集团	5,000	65,450.00	0.04
908	688330	宏力达	1,020	64,953.60	0.04
909	301089	拓新药业	900	64,800.00	0.04
910	300872	天阳科技	5,000	64,650.00	0.04
911	000019	深粮控股	8,500	63,835.00	0.04
912	603055	台华新材	6,300	63,630.00	0.04
913	300255	常山药业	11,600	63,568.00	0.04
914	301216	万凯新材	2,200	63,096.00	0.04
915	002232	启明信息	5,000	62,850.00	0.04
916	603068	博通集成	2,200	62,612.00	0.04
917	003021	兆威机电	1,300	62,491.00	0.04
918	600548	深高速	6,900	61,962.00	0.04
919	300219	鸿利智汇	9,100	60,788.00	0.04
920	003006	百亚股份	4,400	60,764.00	0.04
921	000885	城发环境	6,400	60,608.00	0.04
922	600569	安阳钢铁	29,200	60,444.00	0.04
923	688318	财富趋势	676	60,265.40	0.04
924	000058	深赛格	7,600	60,040.00	0.04
925	301236	软通动力	1,700	59,806.00	0.04
926	300318	博晖创新	10,200	59,670.00	0.04
927	300887	谱尼测试	1,800	58,698.00	0.04
928	605007	五洲特纸	3,100	58,435.00	0.04
929	301087	可孚医疗	1,600	58,368.00	0.04
930	000011	深物业A	5,000	57,950.00	0.04
931	600370	三房巷	19,100	57,873.00	0.04
932	688161	威高骨科	1,105	57,669.95	0.04
933	603439	贵州三力	4,200	57,624.00	0.04
934	300590	移为通信	5,850	57,388.50	0.04
935	605136	丽人丽妆	4,100	57,318.00	0.04
936	603693	江苏新能	4,420	57,150.60	0.04
937	603258	电魂网络	2,600	56,862.00	0.04
938	603013	亚普股份	3,900	55,887.00	0.04
939	000761	本钢板材	18,900	55,755.00	0.04
940	002641	公元股份	12,600	55,440.00	0.04
941	603610	麒盛科技	4,600	55,430.00	0.04
942	600841	动力新科	9,100	55,237.00	0.04
943	002990	盛视科技	2,000	54,860.00	0.03
944	002636	金安国纪	7,000	54,530.00	0.03
945	600618	氯碱化工	5,500	54,065.00	0.03
946	600403	大有能源	11,700	53,937.00	0.03
947	605008	长鸿高科	3,300	53,823.00	0.03

948	002913	奥士康	2,200	53,614.00	0.03
949	301090	华润材料	5,300	53,318.00	0.03
950	300215	电科院	9,600	52,896.00	0.03
951	688368	晶丰明源	470	52,499.00	0.03
952	300860	锋尚文化	1,000	52,030.00	0.03
953	002651	利君股份	7,900	51,666.00	0.03
954	301080	百普赛斯	500	51,345.00	0.03
955	003009	中天火箭	1,300	51,285.00	0.03
956	300616	尚品宅配	2,600	51,064.00	0.03
957	301177	迪阿股份	800	50,384.00	0.03
958	300127	银河磁体	3,300	50,127.00	0.03
959	603297	永新光学	600	49,806.00	0.03
960	300942	易瑞生物	2,900	49,706.00	0.03
961	605199	葫芦娃	3,100	49,662.00	0.03
962	002946	新乳业	3,600	47,628.00	0.03
963	600935	华塑股份	10,500	47,250.00	0.03
964	603071	物产环能	2,900	46,922.00	0.03
965	002724	海洋王	5,800	46,864.00	0.03
966	301206	三元生物	1,200	46,800.00	0.03
967	300829	金丹科技	2,100	45,801.00	0.03
968	003039	顺控发展	2,700	45,657.00	0.03
969	688699	明微电子	991	45,476.99	0.03
970	002961	瑞达期货	3,400	45,322.00	0.03
971	605339	南侨食品	1,900	43,225.00	0.03
972	603093	南华期货	4,700	42,817.00	0.03
973	600903	贵州燃气	5,500	42,625.00	0.03
974	603053	成都燃气	4,500	41,175.00	0.03
975	002287	奇正藏药	1,800	41,130.00	0.03
976	605296	神农集团	1,600	40,048.00	0.03
977	300815	玉禾田	2,600	39,598.00	0.03
978	300981	中红医疗	2,100	39,438.00	0.03
979	002911	佛燃能源	3,200	38,368.00	0.02
980	688001	华兴源创	1,400	37,660.00	0.02
981	688128	中国电研	2,117	36,158.36	0.02
982	301207	华兰疫苗	800	35,664.00	0.02
983	301268	铭利达	700	35,147.00	0.02
984	001308	康冠科技	1,100	34,144.00	0.02
985	301200	大族数控	800	31,360.00	0.02
986	601068	中铝国际	6,600	31,086.00	0.02
987	688788	科思科技	850	30,676.50	0.02
988	001323	慕思股份	900	29,808.00	0.02
989	603235	天新药业	1,000	29,120.00	0.02
990	603530	神马电力	1,900	28,519.00	0.02

991	603132	金徽股份	2,200	26,334.00	0.02
992	688739	成大生物	850	25,857.00	0.02
993	601279	英利汽车	5,100	25,602.00	0.02
994	603170	宝立食品	900	25,497.00	0.02
995	002975	博杰股份	800	25,336.00	0.02
996	603103	横店影视	1,600	23,584.00	0.02
997	301078	孩子王	1,800	23,310.00	0.01
998	605365	立达信	1,200	19,296.00	0.01
999	301180	万祥科技	900	14,805.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688800	瑞可达	1,445	154,152.60	0.10
2	688432	有研硅	6,213	69,834.12	0.04
3	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
4	688132	邦彦技术	2,180	49,704.00	0.03
5	688525	佰维存储	2,922	44,618.94	0.03
6	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.02
7	301327	华宝新能	73	12,918.81	0.01
8	301301	川宁生物	1,207	9,088.71	0.01
9	301367	怡和嘉业	51	8,964.78	0.01
10	301297	富乐德	675	8,768.25	0.01
11	301311	昆船智能	536	8,500.96	0.01
12	301267	华夏眼科	124	8,208.80	0.01
13	301152	天力锂能	169	7,882.16	0.01
14	301230	泓博医药	157	7,586.24	0.00
15	301361	众智科技	351	7,356.96	0.00
16	301165	锐捷网络	229	7,238.69	0.00
17	301296	新巨丰	478	7,122.20	0.00
18	301396	宏景科技	222	7,081.80	0.00
19	301363	美好医疗	182	6,888.70	0.00
20	301161	唯万密封	312	6,779.76	0.00
21	301328	维峰电子	87	6,695.52	0.00
22	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
23	301283	聚胶股份	123	6,323.43	0.00
24	301339	通行宝	405	6,313.95	0.00
25	301290	东星医疗	172	6,042.36	0.00
26	301227	森鹰窗业	204	6,015.96	0.00
27	301277	新天地	232	5,980.96	0.00
28	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
29	301326	捷邦科技	154	5,639.48	0.00
30	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
31	301282	金禄电子	220	5,555.00	0.00

32	301313	凡拓数创	183	5,332.62	0.00
33	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
34	301171	易点天下	279	4,943.88	0.00
35	301285	鸿日达	383	4,825.80	0.00
36	301349	信德新材	46	4,761.92	0.00
37	301176	逸豪新材	280	4,729.20	0.00
38	301319	唯特偶	80	4,261.60	0.00
39	301388	欣灵电气	169	3,650.40	0.00
40	301265	华新环保	318	3,625.20	0.00
41	301300	远翔新材	123	3,612.51	0.00
42	301309	万得凯	115	2,812.90	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002176	江特电机	1,950,268.00	3.61
2	002738	中矿资源	1,748,532.00	3.24
3	002405	四维图新	1,702,565.00	3.15
4	300568	星源材质	1,395,676.91	2.59
5	002850	科达利	1,323,147.00	2.45
6	002192	融捷股份	1,253,516.00	2.32
7	002432	九安医疗	1,237,446.00	2.29
8	000933	神火股份	1,148,314.00	2.13
9	002472	双环传动	1,144,904.00	2.12
10	300438	鹏辉能源	1,138,136.00	2.11
11	300118	东方日升	1,113,697.00	2.06
12	300395	菲利华	1,094,106.00	2.03
13	000762	西藏矿业	1,053,272.00	1.95
14	000683	远兴能源	1,040,678.00	1.93
15	000422	湖北宜化	1,009,756.00	1.87
16	002312	川发龙蟒	991,354.00	1.84
17	300604	长川科技	976,178.00	1.81
18	002240	盛新锂能	930,090.00	1.72
19	300343	联创股份	916,103.00	1.70
20	300725	药石科技	910,437.00	1.69

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002738	中矿资源	1,801,370.48	3.34

2	300568	星源材质	1,502,947.19	2.78
3	002192	融捷股份	1,320,619.17	2.45
4	002850	科达利	1,263,809.00	2.34
5	300604	长川科技	1,174,541.60	2.18
6	002176	江特电机	1,170,638.00	2.17
7	000683	远兴能源	1,154,902.42	2.14
8	002025	航天电器	974,793.00	1.81
9	000591	太阳能	923,175.00	1.71
10	300850	新强联	915,779.88	1.70
11	688063	派能科技	888,783.68	1.65
12	002405	四维图新	832,361.00	1.54
13	000155	川能动力	810,641.00	1.50
14	000933	神火股份	795,717.00	1.47
15	300438	鹏辉能源	779,240.00	1.44
16	300395	菲利华	758,631.00	1.41
17	002531	天顺风能	752,239.00	1.39
18	600873	梅花生物	740,877.00	1.37
19	603606	东方电缆	722,524.00	1.34
20	300373	扬杰科技	720,009.00	1.33

注：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	251,024,799.73
卖出股票收入（成交）总额	157,331,260.21

注：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）	67,664.26	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,664.26	0.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110091	合力转债	370	37,003.08	0.02
2	118027	宏图转债	200	24,459.96	0.02
3	127077	华宏转债	62	6,201.22	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，江特电机（002176）于 2021 年 12 月 10 日因公司涉嫌信息披露违规被中国证券监督管理委员会立案调查，证监立案字 0252021009 号，并于 2022 年 3 月 11 日，被责令改正，给与警告并处以 60 万元的罚款，并对公司相关负责人处以 8 万-30 万元不等的罚款。同时于 2022 年 9 月 14 日和 2022 年 10 月 14 日因信息披露虚假或严重误导性陈述，分别收到中国证券监督管理委员会和中国证券监督管理委员会江西监管局给予的责令改正，公开批评并公开处罚处分的决定。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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	233,023.04
2	应收清算款	659,325.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	892,348.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688432	有研硅	69,834.12	0.04	新股锁定期内
2	688132	邦彦技术	49,704.00	0.03	新股锁定期内
3	688525	佰维存储	44,618.94	0.03	新股锁定期内

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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 (%)

2,081	75,253.33	117,117,882.00	74.79	39,484,300.00	25.21
-------	-----------	----------------	-------	---------------	-------

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	BARCLAYS BANK PLC	21,000,000.00	13.41
2	中国国际金融股份有限公司	18,623,800.00	11.89
3	太平洋资管—工商银行—太平洋卓越七十三号产品	13,349,500.00	8.52
4	广发证券股份有限公司	10,570,000.00	6.75
5	方正证券股份有限公司	9,656,532.00	6.17
6	太平洋资管—工商银行—太平洋卓越八十三号产品	7,121,900.00	4.55
7	中信证券股份有限公司	6,297,088.00	4.02
8	太平洋资管—工商银行—太平洋卓越八十六号产品	6,230,200.00	3.98
9	中邮理财有限责任公司—邮银财富·鸿锦一年定开 46 号	5,000,000.00	3.19
10	太平洋资管—招商银行—太平洋卓越臻远核心价值二号产品	4,467,500.00	2.85

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	0.00	0.0000

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、基金投资和研发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15日） 基金份额总额	222,602,182.00
本报告期期初基金份额总额	42,602,182.00
本报告期基金总申购份额	291,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	177,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	156,602,182.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

2022 年 3 月 15 日，公司股东会书面决定 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司第六届董事会董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

2022 年 11 月 18 日，公司进行董事会、监事会换届选举，股东会批准贾波先生、陆春光先生、韩勇先生、Kirk Chester SWEENEY 先生、杨智雅女士担任公司第七届董事会董事，陆桢女士、李晗女士、田中荣治先生、孙茂竹先生担任公司第七届董事会独立董事，刘晓冰先生、卞时珍女士、柳军先生、刘声先生担任公司第七届监事会监事。文光伟先生、李亦宜女士不再担任公司独立董事。

2022 年 12 月 12 日，经公司董事会批准裴晓思先生担任公司副总经理，周俊梁先生担任公司财务总监。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金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 50,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 年的审计服务。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	6	403,174,430.29	100.00	371,862.52	100.00	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)				的比例 (%)
招商证券	409,893.28	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金风险等级相关事项的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 12 月 15 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 12 月 13 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 12 月 1 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 11 月 23 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 11 月 10 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 11 月 3 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申赎旗下公募基金免除相关费用的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 10 月 10 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 30 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海中欧财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 28 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 9 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 4 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 8 月 24 日

13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 8 月 14 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金最小申购赎回单位的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 29 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金变更基金扩位证券简称的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 28 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 22 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司、乾道基金销售有限公司销售机构办理相关销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 20 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 17 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 7 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 17 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 17 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 29 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 23 日
24	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 13 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 1 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告	
--	--------------------	--

§ 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	20220613-20220721;	0.00	15,759,600.00	0.00	15,759,600.00	10.06
	2	20220721-20220722;	0.00	17,672,000.00	17,672,000.00	0.00	0.00
	3	20220101-20220610;	11,619,300.00	4,140,300.00	15,759,600.00	0.00	0.00

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日