

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 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 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	75
§ 8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末上市基金前十名持有人	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	77
§ 9 开放式基金份额变动	77
§ 10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
10.8 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	80
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 1000
场内简称	中证 1000 (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	114,102,182.00 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

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
登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	931,059.46
本期利润	10,395,032.08
加权平均基金份额本期利润	0.0695
本期加权平均净值利润率	6.43%
本期基金份额净值增长率	6.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,340,773.59
期末可供分配基金份额利润	0.0293
期末基金资产净值	122,044,394.11
期末基金份额净值	1.0696
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.96%

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

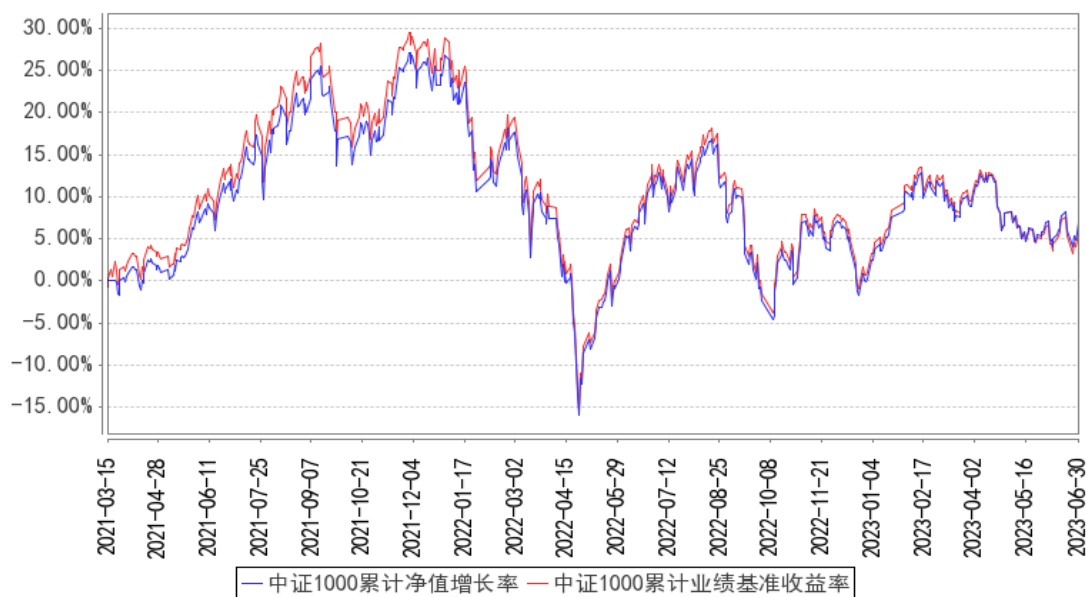
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	1.07%	1.03%	0.62%	1.05%	0.45%	-0.02%
过去三个月	-2.73%	0.90%	-3.98%	0.92%	1.25%	-0.02%
过去六个月	6.67%	0.87%	5.10%	0.89%	1.57%	-0.02%
过去一年	-4.03%	1.09%	-5.62%	1.10%	1.59%	-0.01%
自基金合同生效起至今	6.96%	1.28%	6.13%	1.31%	0.83%	-0.03%

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

中证1000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 2023 年 6 月 30 日。

§ 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），华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金，华泰柏瑞招享6个月持有期混合型证券投资基金，华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII），华泰柏瑞上证50指数增强型证券投资基金，华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金，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发起式联接基金，华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金，华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金，华泰柏瑞致远混合型证券投资基金，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发起式联接基金。截至2023年6月30日，公司基金管理规模为3,348.66亿元。

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	-	8年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。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月至2022年12月任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。2019年11月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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

					<p>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。2023 年 5 月起任华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 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发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次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，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 4 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

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

2023 年上半年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、机械设备的表现相对较好，涨跌幅分别为 50.66%、42.75%、27.57% 和 13.44%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为 -0.75%、2.29%、5.10% 和 -5.61%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 3.65% 和 -6.15%，中证 500 价值相对中证 500 成长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 0.020%，期间日跟踪误差为 0.033%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0696 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.67%，业绩比较基准收益率为 5.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年以来，中国面临的内部和外部环境仍旧复杂多变，国内经济复苏斜率有所放缓，国内有效需求不足。在此背景下资本市场投资者预期也发生了较大的变化，前期市场已经注入较多悲观预期，甚至是一些较为长期的经济需转型的问题，放大了短期经济下行的压力，究其原因还是在于重新开放后对于中国经济增长中枢的判断。展望后市，国内主要市场主体都处于资产负债表修复阶段，政策组合陆续出台，市场风险偏好显著提振。建议关注政策友好期带来的顺周期行情。

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。

4.6 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。

4.7 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 3,340,773.59 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	5,881,885.53	2,630,492.59
结算备付金		151,791.98	116,114.91
存出保证金		134,180.27	233,023.04
交易性金融资产	6.4.7.2	119,417,163.56	155,413,737.80
其中: 股票投资		119,377,760.28	155,346,073.54
基金投资		-	-
债券投资		39,403.28	67,664.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	659,325.41
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	-
资产总计		125,660,637.58	159,052,693.75
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		8,253.60	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,628,527.47	768,405.65
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		61,575.16	71,513.52
应付托管费		12,315.04	14,302.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.21	0.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,905,571.99	1,179,580.00

负债合计		3,616,243.47	2,033,802.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	114,102,182.00	156,602,182.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,942,212.11	416,709.35
净资产合计		122,044,394.11	157,018,891.35
负债和净资产总计		125,660,637.58	159,052,693.75

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0696 元，基金份额总额 114,102,182.00 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,043,743.43	-5,943,494.50
1. 利息收入		24,133.58	11,746.23
其中：存款利息收入	6.4.7.13	24,133.58	11,746.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,245,136.92	-1,741,831.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,845.58	-2,147,531.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	71,389.25	8,421.94
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,161,902.09	397,278.44
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	6.4.7.20	9,463,972.62	-4,317,662.57

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.21	310,500.31	104,253.09
减: 二、营业总支出		648,711.35	303,232.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	400,090.01	128,721.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	80,017.99	25,744.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.04	-
8. 其他费用	6.4.7.23	168,603.31	148,767.52
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		10,395,032.08	-6,246,727.39
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		10,395,032.08	-6,246,727.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,395,032.08	-6,246,727.39

6.3 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: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
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)	156,602,182.00	-	416,709.35	157,018,891.35
三、本期增减变动额 (减少以“-”	-42,500,000.00	-	7,525,502.76	-34,974,497.24

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	10,395,032.08	10,395,032.08
(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)	-42,500,000.00	-	-2,869,529.32	-45,369,529.32
其中: 1. 基金申购款	75,000,000.00	-	5,814,286.67	80,814,286.67
2. 基金赎回款	-117,500,000.00	-	-8,683,815.99	-126,183,815.99
(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)	114,102,182.00	-	7,942,212.11	122,044,394.11
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	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)	21,000,000.00	-	-4,084,456.55	16,915,543.45
(一)、综合收益总额	-	-	-6,246,727.39	-6,246,727.39
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	21,000,000.00	-	2,162,270.84	23,162,270.84

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	39,000,000.00	-	3,726,332.53	42,726,332.53
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-	-1,564,061.69	-19,564,061.69
(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)	63,602,182.00	-	7,284,720.07	70,886,902.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>韩勇</u>	<u>房伟力</u>	<u>赵景云</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证 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 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,881,885.53
等于：本金	5,880,293.47
加：应计利息	1,592.06
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	5,881,885.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	121,259,884.04	-	119,377,760.28	-1,882,123.76
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	39,400.00	3.28	39,403.28	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	39,400.00	3.28	39,403.28	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		121,299,284.04	3.28	119,417,163.56	-1,882,123.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30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	106,757.23
其中：交易所市场	106,757.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,219.55
应退退补款	1,664,595.21
合计	1,905,571.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,602,182.00	156,602,182.00
本期申购	75,000,000.00	75,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-117,500,000.00	-117,500,000.00
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	114,102,182.00	114,102,182.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,561,495.02	-3,144,785.67	416,709.35
本期利润	931,059.46	9,463,972.62	10,395,032.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,151,780.89	-1,717,748.43	-2,869,529.32
其中：基金申购款	2,040,459.39	3,773,827.28	5,814,286.67
基金赎回款	-3,192,240.28	-5,491,575.71	-8,683,815.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,340,773.59	4,601,438.52	7,942,212.11

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	21,260.54
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	1,484.83
其他	1,388.21
合计	24,133.58

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	722,477.20
股票投资收益——赎回差价收入	-710,631.62
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	11,845.58

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	98,263,182.64

减：卖出股票成本总额	97,273,702.26
减：交易费用	267,003.18
买卖股票差价收入	722,477.20

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	126,183,815.99
减：现金支付赎回款总额	82,679,334.99
减：赎回股票成本总额	44,215,112.62
减：交易费用	-
赎回差价收入	-710,631.62

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	50.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	71,339.25
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	71,389.25

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	326,109.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	254,700.00
减：应计利息总额	57.38
减：交易费用	13.03
买卖债券差价收入	71,339.25

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,161,902.09
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,161,902.09

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	9,463,972.62
股票投资	9,468,426.62
债券投资	-4,454.00
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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	9,463,972.62

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	310,500.31
合计	310,500.31

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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算发布费	9,916.99
合计	168,603.31

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人
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
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
招商证券	166,646,601.32	100.00	60,395,914.31	100.00

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	153,781.38	100.00	106,757.23	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	55,558.39	100.00	41,100.23	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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	400,090.01	128,721.12
其中：支付销售机构的客户维护费	6,609.85	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,017.99	25,744.25

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	4,036,800.00	3.5379	1,400,462.00	0.8943

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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。

6.4.10.7 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 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	3,582	58,171.68
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,156	18,380.40

华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	18,353	104,428.57
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	2,667	55,793.64
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	6,747	74,891.70
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	1,313	55,736.85
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	1,968	37,785.60
招商证券	301428	世纪恒通	网下申购	1,430	37,680.50
招商证券	301305	朗坤环境	网下申购	2,549	64,362.25
华泰联合证券	123188	水羊转债	网上配售	98	9,800.00
华泰联合证券	127084	柳工转 2	网上配售	361	36,100.00
华泰联合证券	113666	爱玛转债	网上配售	140	14,000.00
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	496	19,309.28

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	27.93	33.03	62	1,731.66	2,047.86	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	21.02	205	2,435.40	4,309.10	-
001324	长青	2023 年 5 月	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	77	1,453.76	1,509.20	-

	科技	12 日		期内						
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股 锁定期内	20.68	25.49	62	1,282.16	1,580.38	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定期内	15.38	14.87	78	1,199.64	1,159.86	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 锁定期内	44.48	39.48	30	1,334.40	1,184.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股 锁定期内	28.84	30.78	96	2,768.64	2,954.88	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 锁定期内	42.45	32.97	132	5,603.40	4,352.04	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股 锁定期内	41.20	42.69	141	5,809.20	6,019.29	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股 锁定期内	56.50	52.93	72	4,068.00	3,810.96	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股 锁定期内	34.00	34.93	125	4,250.00	4,366.25	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股 未上市	25.82	25.82	1,197	30,906.54	30,906.54	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股 锁定期内	35.66	33.26	195	6,953.70	6,485.70	-
301232	飞沃	2023 年 6 月	6 个月	新股 锁定	72.50	58.42	87	6,307.50	5,082.54	-

	科技	8 日		期内						
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	902	33,283.80	33,283.80	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	30.22	25.50	226	6,829.72	5,763.00	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	44.18	25.10	169	5,345.78	4,241.90	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	38.13	31.03	222	8,464.86	6,888.66	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	2,523	50,434.77	50,434.77	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	29.60	71.42	150	4,440.00	10,713.00	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	37.40	36.07	164	6,133.60	5,915.48	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	5.00	8.96	1,207	6,035.00	10,814.72	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	25.25	19.69	255	6,438.75	5,020.95	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	32.29	51.12	139	4,488.31	7,105.68	-
301317	鑫磊股	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	20.67	26.17	374	7,730.58	9,787.58	-

	份									
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定期内	13.06	20.62	501	6,543.06	10,330.62	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定期内	39.06	39.36	109	4,257.54	4,290.24	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	76.80	107.95	91	6,988.80	9,823.45	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	14.81	13.73	351	5,198.31	4,819.23	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	32.60	30.37	119	3,879.40	3,614.03	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	73.45	46.64	67	4,921.15	3,124.88	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定期内	17.55	16.75	295	5,177.25	4,941.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	50.00	48.39	92	4,600.00	4,451.88	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定期内	23.77	42.89	191	4,540.07	8,191.99	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定期内	71.88	92.60	61	4,384.68	5,648.60	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定期内	33.73	31.85	128	4,317.44	4,076.80	-
301376	致	2023	6个月	新股	24.66	22.51	193	4,759.38	4,344.43	-

	欧科技	年6月14日		锁定期内						
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定期内	23.80	32.84	190	4,522.00	6,239.60	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定期内	29.99	23.79	165	4,948.35	3,925.35	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定期内	53.27	40.20	114	6,072.78	4,582.80	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股锁定期内	43.99	51.57	137	6,026.63	7,065.09	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定期内	16.24	16.95	359	5,830.16	6,085.05	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定期内	24.80	43.85	187	4,637.60	8,199.95	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定期内	26.35	30.60	143	3,768.05	4,375.80	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	28.75	21.02	266	7,647.50	5,591.32	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定期内	19.99	16.90	200	3,998.00	3,380.00	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	920	53,047.20	53,047.20	-
301488	豪恩汽	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	1,110	44,155.80	44,155.80	-

	电									
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期内	39.78	39.78	124	4,932.72	4,932.72	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	6.58	7.58	473	3,112.34	3,585.34	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	10.36	11.84	146	1,512.56	1,728.64	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定期内	11.66	12.26	148	1,725.68	1,814.48	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定期内	25.98	24.53	51	1,324.98	1,251.03	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股锁定期内	17.80	17.89	159	2,830.20	2,844.51	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股锁定期内	15.90	17.09	116	1,844.40	1,982.44	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定期内	14.58	16.13	107	1,560.06	1,725.91	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期内	19.86	18.06	975	19,363.50	17,608.50	-
688307	中润光学	2023年2月8日	6个月	新股锁定期内	23.88	31.73	1,788	42,697.44	56,733.24	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定期内	14.16	16.21	358	5,069.28	5,803.18	-

688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定期内	12.10	12.07	453	5,481.30	5,467.71	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定期内	23.60	64.67	150	3,540.00	9,700.50	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定期内	19.20	25.53	197	3,782.40	5,029.41	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期内	26.66	31.50	146	3,892.36	4,599.00	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定期内	37.88	29.49	347	13,144.36	10,233.03	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定期内	75.00	90.76	67	5,025.00	6,080.92	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定期内	5.69	5.41	1,836	10,446.84	9,932.76	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定期内	11.10	17.04	675	7,492.50	11,502.00	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定期内	33.99	29.49	108	3,670.92	3,184.92	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定期内	39.99	36.71	156	6,238.44	5,726.76	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期内	20.92	19.16	267	5,585.64	5,115.72	-
688523	航天环	2023年5月26日	6个月	新股锁定期内	21.86	23.85	238	5,202.68	5,676.30	-

688535	宇 华 海 诚 科	2023 年3月 28日	6个月	新股 锁定 期内	35.00	51.23	97	3,395.00	4,969.31	-
688543	国 科 军 工	2023 年6月 14日	6个月	新股 锁定 期内	43.67	53.05	116	5,065.72	6,153.80	-
688552	航 天 南 湖	2023 年5月 8日	6个月	新股 锁定 期内	21.17	23.50	219	4,636.23	5,146.50	-
688562	航 天 软 件	2023 年5月 15日	6个月	新股 锁定 期内	12.68	22.31	317	4,019.56	7,072.27	-
688581	安 杰 思	2023 年5月 12日	6个月	新股 锁定 期内	125.80	118.03	39	4,906.20	4,603.17	-
688582	芯 动 联 科	2023 年6月 21日	6个月	新股 锁定 期内	26.74	40.68	164	4,385.36	6,671.52	-
688593	新 相 微	2023 年5月 25日	6个月	新股 锁定 期内	11.18	14.59	408	4,561.44	5,952.72	-
688603	天 承 科 技	2023 年6月 30日	1个月 内(含)	新股 未上 市	55.00	55.00	660	36,300.00	36,300.00	-
688620	安 凯 微	2023 年6月 15日	6个月	新股 锁定 期内	10.68	12.34	456	4,870.08	5,627.04	-
688623	双 元 科 技	2023 年5月 31日	6个月	新股 锁定 期内	125.88	86.79	48	6,042.24	4,165.92	-
688629	华 丰 科 技	2023 年6月 16日	6个月	新股 锁定 期内	9.26	18.59	437	4,046.62	8,123.83	-
688631	莱 斯	2023 年6月	6个月	新股 锁定	25.28	29.87	130	3,286.40	3,883.10	-

	信息	19 日		期内						
6.4.12.1.2 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
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 12 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	394	39,403.28	39,403.28	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300346	南大光电	2023 年 6 月 26 日	重大事项停牌	34.39	2023 年 7 月 6 日	35.60	8,200	271,477.80	281,998.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无

债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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 2023 年 6 月 30 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 0.03% (2022 年 12 月 31 日：0.04%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 6.4.12。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 2023 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 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	5,881,885.53	-	-	-	-	-	5,881,885.53
结算备付金	151,791.98	-	-	-	-	-	151,791.98
存出保证金	134,180.27	-	-	-	-	-	134,180.27
交易性金融资产	-	-	39,403.28	-	-	119,377,760.28	119,417,163.56
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	6,167,857.78	-	39,403.28	-	-	119,453,376.52	125,660,637.58
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	8,253.60	8,253.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	61,575.16	61,575.16
应付托管费	-	-	-	-	-	12,315.04	12,315.04
应付清算款	-	-	-	-	-	1,628,527.47	1,628,527.47
应交税费	-	-	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	-	-	1,905,571.99	1,905,571.99
负债总计	-	-	-	-	-	3,616,243.47	3,616,243.47
利率敏感度缺	6,167,857.78	-	39,403.28	-	-	115,837,133.05	122,044,394.11

口							
上年度末 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	

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 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 0.03% (2022 年 12 月 31 日：0.04%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	119,377,760.28	97.82	155,346,073.54	98.93
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	-8,253.60	-0.01	-	-
合计	119,369,506.68	97.81	155,346,073.54	98.93

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	中证 1000 指数上升 5%	5,874,227.94	7,616,337.89
	中证 1000 指数下降 5%	-5,874,227.94	-7,616,337.89

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	118,350,157.43	154,935,138.65
第二层次	574,462.11	85,702.30
第三层次	492,544.02	392,896.85
合计	119,417,163.56	155,413,737.80

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	119,377,760.28	95.00
	其中：股票	119,377,760.28	95.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,403.28	0.03
	其中：债券	39,403.28	0.03
	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	6,033,677.51	4.80
8	其他各项资产	209,796.51	0.17
9	合计	125,660,637.58	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	933,041.40	0.76
B	采矿业	3,244,126.80	2.66
C	制造业	78,445,879.96	64.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,333,404.40	2.73
E	建筑业	2,380,834.20	1.95
F	批发和零售业	3,146,940.40	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	2,116,795.00	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,388,780.91	11.79
J	金融业	2,747,649.10	2.25
K	房地产业	2,224,933.00	1.82
L	租赁和商务服务业	795,877.30	0.65
M	科学研究和技术服务业	1,522,972.82	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	1,042,305.80	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,167.00	0.04
Q	卫生和社会工作	848,700.00	0.70
R	文化、体育和娱乐	1,260,353.00	1.03

	业		
S	综合	76,568.00	0.06
	合计	118,554,329.09	97.14

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	703,087.35	0.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.03
E	建筑业	3,796.92	0.00
F	批发和零售业	18,323.92	0.02
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	41,238.40	0.03
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	5,803.18	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,020.95	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,713.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	823,431.19	0.67

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300502	新易盛	12,560	853,703.20	0.70
2	002405	四维图新	42,300	489,834.00	0.40
3	603345	安井食品	3,300	484,440.00	0.40
4	002517	恺英网络	30,700	483,218.00	0.40
5	002436	兴森科技	29,500	457,250.00	0.37
6	300394	天孚通信	4,200	448,686.00	0.37
7	002558	巨人网络	24,600	441,078.00	0.36
8	002472	双环传动	11,900	431,970.00	0.35
9	300002	神州泰岳	30,700	429,800.00	0.35
10	002044	美年健康	55,500	394,605.00	0.32
11	600872	中炬高新	10,600	389,974.00	0.32
12	300315	掌趣科技	49,600	386,880.00	0.32
13	600129	太极集团	6,400	380,736.00	0.31
14	688037	芯源微	2,203	376,602.85	0.31
15	002865	钧达股份	2,437	371,715.61	0.30
16	002176	江特电机	30,400	362,368.00	0.30
17	300339	润和软件	14,600	349,816.00	0.29
18	002261	拓维信息	18,100	349,511.00	0.29
19	300054	鼎龙股份	13,600	336,328.00	0.28
20	688050	爱博医疗	1,626	333,866.58	0.27
21	600100	同方股份	41,000	332,920.00	0.27
22	000818	航锦科技	9,900	330,363.00	0.27
23	688017	绿的谐波	2,028	329,347.20	0.27
24	688598	金博股份	1,885	323,277.50	0.26
25	300573	兴齐眼药	1,500	320,700.00	0.26
26	000860	顺鑫农业	9,500	320,055.00	0.26
27	688617	惠泰医疗	850	317,687.50	0.26
28	300777	中简科技	6,600	311,916.00	0.26
29	300068	南都电源	15,900	307,824.00	0.25
30	603129	春风动力	1,900	307,610.00	0.25
31	600559	老白干酒	12,500	306,375.00	0.25
32	300567	精测电子	3,200	304,480.00	0.25
33	601099	太平洋	117,400	302,892.00	0.25
34	600777	新潮能源	118,300	299,299.00	0.25
35	600771	广誉远	8,400	296,268.00	0.24
36	300459	汤姆猫	43,900	284,911.00	0.23
37	002262	恩华药业	9,200	283,636.00	0.23
38	688066	航天宏图	4,645	282,880.50	0.23
39	300346	南大光电	8,200	281,998.00	0.23
40	002402	和而泰	16,300	276,774.00	0.23
41	688556	高测股份	5,144	273,352.16	0.22
42	300476	胜宏科技	11,300	272,443.00	0.22
43	000690	宝新能源	38,600	270,972.00	0.22

44	002389	航天彩虹	12,200	270,962.00	0.22
45	300114	中航电测	5,500	270,325.00	0.22
46	002747	埃斯顿	9,600	268,800.00	0.22
47	300229	拓尔思	10,200	264,894.00	0.22
48	002456	欧菲光	46,800	262,080.00	0.21
49	300456	赛微电子	10,700	261,936.00	0.21
50	600711	盛屯矿业	53,600	260,496.00	0.21
51	000032	深桑达 A	7,900	259,910.00	0.21
52	002126	银轮股份	14,500	256,650.00	0.21
53	688235	百济神州	2,305	251,498.55	0.21
54	600363	联创光电	6,600	244,860.00	0.20
55	002851	麦格米特	6,700	244,349.00	0.20
56	688139	海尔生物	4,747	244,328.09	0.20
57	002145	中核钛白	41,190	242,609.10	0.20
58	002139	拓邦股份	18,400	240,120.00	0.20
59	002484	江海股份	11,100	236,319.00	0.19
60	002151	北斗星通	6,700	235,572.00	0.19
61	603179	新泉股份	5,300	232,617.00	0.19
62	002832	比音勒芬	6,500	230,165.00	0.19
63	601677	明泰铝业	16,560	229,852.80	0.19
64	605589	圣泉集团	10,500	228,270.00	0.19
65	688083	中望软件	1,564	226,607.96	0.19
66	600338	西藏珠峰	12,400	226,424.00	0.19
67	688023	安恒信息	1,272	222,231.12	0.18
68	002312	川发龙蟒	27,300	221,949.00	0.18
69	002174	游族网络	13,100	220,080.00	0.18
70	600583	海油工程	37,600	219,960.00	0.18
71	002335	科华数据	6,100	219,295.00	0.18
72	000921	海信家电	8,100	218,295.00	0.18
73	000034	神州数码	8,200	218,038.00	0.18
74	300393	中来股份	15,400	216,216.00	0.18
75	603027	千禾味业	10,220	215,846.40	0.18
76	600572	康恩贝	31,300	214,405.00	0.18
77	600072	中船科技	7,600	214,092.00	0.18
78	300803	指南针	4,400	213,796.00	0.18
79	300775	三角防务	6,300	212,814.00	0.17
80	300034	钢研高纳	5,400	212,706.00	0.17
81	688019	安集科技	1,290	212,630.70	0.17
82	600587	新华医疗	6,000	211,980.00	0.17
83	000762	西藏矿业	7,100	210,373.00	0.17
84	688088	虹软科技	4,881	208,662.75	0.17
85	300036	超图软件	8,800	208,648.00	0.17
86	603979	金诚信	6,700	208,370.00	0.17

87	600452	涪陵电力	9,780	208,118.40	0.17
88	688262	国芯科技	5,105	207,722.45	0.17
89	300458	全志科技	7,600	207,100.00	0.17
90	002617	露笑科技	26,200	206,456.00	0.17
91	002610	爱康科技	80,300	205,568.00	0.17
92	600641	万业企业	10,700	204,263.00	0.17
93	300666	江丰电子	3,000	203,880.00	0.17
94	600685	中船防务	6,800	203,660.00	0.17
95	688333	铂力特	1,922	203,232.28	0.17
96	300294	博雅生物	5,600	203,168.00	0.17
97	603063	禾望电气	6,600	202,950.00	0.17
98	002318	久立特材	11,900	202,657.00	0.17
99	002541	鸿路钢构	7,000	201,670.00	0.17
100	002015	协鑫能科	15,000	201,450.00	0.17
101	603728	鸣志电器	2,500	200,750.00	0.16
102	603279	景津装备	6,400	200,704.00	0.16
103	002063	远光软件	23,000	199,640.00	0.16
104	601222	林洋能源	24,300	199,017.00	0.16
105	300170	汉得信息	17,200	198,488.00	0.16
106	300747	锐科激光	6,450	196,596.00	0.16
107	300633	开立医疗	3,600	196,200.00	0.16
108	300130	新国都	6,900	195,477.00	0.16
109	300188	美亚柏科	9,400	195,426.00	0.16
110	002984	森麒麟	6,200	195,052.00	0.16
111	300627	华测导航	6,000	194,820.00	0.16
112	002544	普天科技	8,500	194,650.00	0.16
113	688700	东威科技	1,944	193,875.12	0.16
114	002332	仙琚制药	14,600	193,450.00	0.16
115	600422	昆药集团	9,300	192,696.00	0.16
116	002036	联创电子	19,800	192,258.00	0.16
117	688110	东芯股份	5,317	191,943.70	0.16
118	601975	招商南油	67,000	191,620.00	0.16
119	002212	天融信	19,700	191,090.00	0.16
120	002837	英维克	6,380	191,017.20	0.16
121	603588	高能环境	20,340	190,585.80	0.16
122	002317	众生药业	11,100	188,589.00	0.15
123	002777	久远银海	5,300	187,991.00	0.15
124	688331	荣昌生物	3,365	187,598.75	0.15
125	000875	吉电股份	34,800	187,572.00	0.15
126	600330	天通股份	15,700	187,144.00	0.15
127	002085	万丰奥威	26,900	186,417.00	0.15
128	300451	创业慧康	22,200	186,036.00	0.15
129	603005	晶方科技	9,200	185,840.00	0.15

130	688608	恒玄科技	1,530	185,175.90	0.15
131	300674	宇信科技	10,400	183,872.00	0.15
132	688266	泽璟制药	3,949	183,825.95	0.15
133	000917	电广传媒	25,100	183,481.00	0.15
134	300672	国科微	2,200	183,370.00	0.15
135	300773	拉卡拉	10,500	183,120.00	0.15
136	002643	万润股份	10,500	182,805.00	0.15
137	002219	新里程	40,400	182,608.00	0.15
138	000426	兴业银锡	20,500	182,040.00	0.15
139	000951	中国重汽	10,800	181,980.00	0.15
140	300327	中颖电子	6,500	181,740.00	0.15
141	002276	万马股份	15,000	181,650.00	0.15
142	600761	安徽合力	9,100	181,363.00	0.15
143	002254	泰和新材	7,400	181,078.00	0.15
144	301035	润丰股份	2,300	180,711.00	0.15
145	688639	华恒生物	1,996	180,598.08	0.15
146	002222	福晶科技	6,500	180,310.00	0.15
147	300166	东方国信	16,000	179,840.00	0.15
148	600977	中国电影	12,800	179,840.00	0.15
149	300083	创世纪	24,600	179,826.00	0.15
150	002727	一心堂	6,800	179,520.00	0.15
151	600557	康缘药业	6,500	178,490.00	0.15
152	600312	平高电气	14,400	178,416.00	0.15
153	603713	密尔克卫	2,000	178,180.00	0.15
154	000422	湖北宜化	15,500	177,940.00	0.15
155	300260	新莱应材	4,500	177,840.00	0.15
156	600877	声光电科	11,900	177,786.00	0.15
157	600110	诺德股份	24,400	176,656.00	0.14
158	300638	广和通	7,760	175,996.80	0.14
159	600456	宝钛股份	5,200	175,968.00	0.14
160	600201	生物股份	18,500	175,935.00	0.14
161	601375	中原证券	47,400	175,854.00	0.14
162	002245	蔚蓝锂芯	16,000	175,200.00	0.14
163	688016	心脉医疗	970	174,483.60	0.14
164	605111	新洁能	4,004	174,254.08	0.14
165	688559	海目星	3,704	174,125.04	0.14
166	300133	华策影视	24,500	173,705.00	0.14
167	603599	广信股份	6,400	173,312.00	0.14
168	300332	天壕环境	15,100	173,197.00	0.14
169	003031	中瓷电子	1,300	173,056.00	0.14
170	300298	三诺生物	6,400	173,056.00	0.14
171	603678	火炬电子	5,000	172,300.00	0.14
172	002182	云海金属	7,800	171,522.00	0.14

173	000810	创维数字	10,600	171,402.00	0.14
174	600057	厦门象屿	19,600	170,520.00	0.14
175	002706	良信股份	15,100	169,875.00	0.14
176	603305	旭升集团	6,080	169,449.60	0.14
177	300075	数字政通	6,800	169,184.00	0.14
178	301236	软通动力	6,200	168,702.00	0.14
179	603690	至纯科技	4,840	168,625.60	0.14
180	002099	海翔药业	19,600	168,364.00	0.14
181	002291	遥望科技	12,800	167,680.00	0.14
182	688278	特宝生物	3,815	167,516.65	0.14
183	688568	中科星图	2,077	167,364.66	0.14
184	002675	东诚药业	11,300	166,223.00	0.14
185	601678	滨化股份	35,800	166,112.00	0.14
186	600596	新安股份	15,160	165,698.80	0.14
187	300525	博思软件	10,800	165,672.00	0.14
188	688739	成大生物	5,010	165,129.60	0.14
189	002396	星网锐捷	7,300	164,907.00	0.14
190	300379	东方通	8,000	164,560.00	0.13
191	600478	科力远	23,007	164,269.98	0.13
192	600602	云赛智联	10,900	164,154.00	0.13
193	688707	振华新材	5,326	163,987.54	0.13
194	300655	晶瑞电材	8,200	163,262.00	0.13
195	600225	卓朗科技	26,600	163,058.00	0.13
196	603565	中谷物流	15,085	162,918.00	0.13
197	600446	金证股份	11,200	162,848.00	0.13
198	002698	博实股份	9,300	162,657.00	0.13
199	301050	雷电微力	2,500	162,325.00	0.13
200	000681	视觉中国	8,800	161,832.00	0.13
201	000686	东北证券	23,300	161,702.00	0.13
202	600151	航天机电	18,100	161,271.00	0.13
203	002324	普利特	11,300	161,251.00	0.13
204	600633	浙数文化	9,900	160,479.00	0.13
205	600483	福能股份	13,800	159,390.00	0.13
206	688106	金宏气体	5,854	159,228.80	0.13
207	002079	苏州固锝	10,900	159,140.00	0.13
208	600323	瀚蓝环境	8,400	159,012.00	0.13
209	300065	海兰信	12,800	158,592.00	0.13
210	600273	嘉化能源	16,700	157,314.00	0.13
211	002351	漫步者	7,600	157,168.00	0.13
212	002585	双星新材	12,400	155,744.00	0.13
213	300031	宝通科技	6,300	155,736.00	0.13
214	601908	京运通	25,700	155,485.00	0.13
215	300303	聚飞光电	24,800	155,248.00	0.13

216	300185	通裕重工	55,600	155,124.00	0.13
217	000528	柳工	19,600	154,840.00	0.13
218	000503	国新健康	12,900	154,671.00	0.13
219	601399	国机重装	48,600	154,548.00	0.13
220	002649	博彦科技	10,900	154,017.00	0.13
221	300035	中科电气	12,800	153,856.00	0.13
222	300079	数码视讯	25,200	153,720.00	0.13
223	600933	爱柯迪	6,600	153,714.00	0.13
224	002605	姚记科技	3,300	153,219.00	0.13
225	002006	精工科技	7,100	153,147.00	0.13
226	600993	马应龙	5,500	152,955.00	0.13
227	002424	贵州百灵	17,000	152,660.00	0.13
228	688027	国盾量子	964	152,620.48	0.13
229	300226	上海钢联	4,700	152,280.00	0.12
230	300679	电连技术	4,600	152,030.00	0.12
231	300077	国民技术	11,400	151,620.00	0.12
232	300693	盛弘股份	4,100	151,372.00	0.12
233	300101	振芯科技	7,800	151,242.00	0.12
234	300432	富临精工	13,000	151,060.00	0.12
235	002597	金禾实业	6,400	151,040.00	0.12
236	603298	杭叉集团	6,400	150,720.00	0.12
237	002292	奥飞娱乐	15,100	150,698.00	0.12
238	688518	联赢激光	5,407	150,639.02	0.12
239	000403	派林生物	7,500	149,700.00	0.12
240	000821	京山轻机	7,300	149,358.00	0.12
241	002446	盛路通信	15,800	149,310.00	0.12
242	300109	新开源	6,000	149,220.00	0.12
243	600986	浙文互联	23,300	149,120.00	0.12
244	600850	电科数字	6,320	149,088.80	0.12
245	601567	三星医疗	11,800	149,034.00	0.12
246	600116	三峡水利	16,400	148,912.00	0.12
247	300820	英杰电气	1,800	148,284.00	0.12
248	603308	应流股份	8,100	148,230.00	0.12
249	002011	盾安环境	10,700	147,981.00	0.12
250	600055	万东医疗	7,100	147,893.00	0.12
251	603300	华铁应急	27,120	147,804.00	0.12
252	002130	沃尔核材	18,200	147,784.00	0.12
253	603236	移远通信	2,554	147,391.34	0.12
254	300687	赛意信息	5,300	147,234.00	0.12
255	000035	中国天楹	32,100	147,018.00	0.12
256	300236	上海新阳	3,700	146,705.00	0.12
257	688408	中信博	1,724	145,384.92	0.12
258	002004	华邦健康	29,000	145,000.00	0.12

259	688239	航宇科技	2,061	144,166.95	0.12
260	000682	东方电子	14,800	143,856.00	0.12
261	002123	梦网科技	10,800	143,532.00	0.12
262	600206	有研新材	10,900	143,226.00	0.12
263	600963	岳阳林纸	19,400	142,978.00	0.12
264	002020	京新药业	11,100	142,302.00	0.12
265	002807	江阴银行	38,500	142,065.00	0.12
266	601001	晋控煤业	15,100	141,336.00	0.12
267	000028	国药一致	3,240	141,296.40	0.12
268	600395	盘江股份	20,300	141,085.00	0.12
269	600179	安通控股	50,500	140,895.00	0.12
270	300203	聚光科技	6,900	139,863.00	0.11
271	300232	洲明科技	15,300	139,842.00	0.11
272	300343	联创股份	19,700	139,476.00	0.11
273	600821	金开新能	20,200	139,178.00	0.11
274	603876	鼎胜新材	7,240	138,935.60	0.11
275	002701	奥瑞金	30,800	138,908.00	0.11
276	600908	无锡银行	25,900	138,824.00	0.11
277	301155	海力风电	1,800	138,744.00	0.11
278	600197	伊力特	5,100	138,567.00	0.11
279	688388	嘉元科技	5,125	137,965.00	0.11
280	002100	天康生物	16,700	137,775.00	0.11
281	600562	国睿科技	8,500	137,700.00	0.11
282	002217	合力泰	39,000	137,670.00	0.11
283	601212	白银有色	50,500	137,360.00	0.11
284	603997	继峰股份	9,600	137,280.00	0.11
285	601208	东材科技	10,800	137,160.00	0.11
286	688158	优刻得	7,264	137,144.32	0.11
287	600037	歌华有线	16,500	137,115.00	0.11
288	605168	三人行	1,595	137,074.30	0.11
289	600267	海正药业	12,000	136,560.00	0.11
290	002737	葵花药业	5,600	136,304.00	0.11
291	601965	中国汽研	6,600	136,290.00	0.11
292	301039	中集车辆	10,300	136,269.00	0.11
293	688339	亿华通	1,601	136,085.00	0.11
294	002773	康弘药业	7,100	135,752.00	0.11
295	301031	中熔电气	1,000	135,710.00	0.11
296	688425	铁建重工	28,180	135,545.80	0.11
297	000065	北方国际	9,000	135,180.00	0.11
298	600158	中体产业	13,300	135,128.00	0.11
299	600578	京能电力	34,500	134,895.00	0.11
300	300593	新雷能	5,880	134,710.80	0.11
301	300613	富瀚微	2,370	134,473.80	0.11

302	300457	赢合科技	7,600	134,216.00	0.11
303	688007	光峰科技	6,412	133,690.20	0.11
304	300416	苏试试验	6,200	133,672.00	0.11
305	002567	唐人神	20,100	133,665.00	0.11
306	603368	柳药集团	5,400	133,434.00	0.11
307	688018	乐鑫科技	1,025	133,065.50	0.11
308	600586	金晶科技	17,200	132,784.00	0.11
309	688270	臻镭科技	2,035	132,132.55	0.11
310	002847	盐津铺子	1,550	131,827.50	0.11
311	000555	神州信息	10,700	131,610.00	0.11
312	600750	江中药业	6,000	131,580.00	0.11
313	002839	张家港行	31,100	131,553.00	0.11
314	688133	泰坦科技	1,544	131,533.36	0.11
315	600797	浙大网新	18,400	131,376.00	0.11
316	600063	皖维高新	26,000	131,300.00	0.11
317	002091	江苏国泰	17,400	131,196.00	0.11
318	300406	九强生物	5,600	130,648.00	0.11
319	688321	微芯生物	5,769	130,610.16	0.11
320	000989	九芝堂	9,400	130,096.00	0.11
321	603477	巨星农牧	3,900	130,065.00	0.11
322	688680	海优新材	1,067	129,981.94	0.11
323	600916	中国黄金	11,000	129,910.00	0.11
324	300369	绿盟科技	10,500	129,885.00	0.11
325	600120	浙江东方	33,900	129,837.00	0.11
326	600869	远东股份	23,500	129,720.00	0.11
327	000543	皖能电力	19,600	129,360.00	0.11
328	002413	雷科防务	24,700	129,181.00	0.11
329	688033	天宜上佳	6,750	129,060.00	0.11
330	688167	炬光科技	1,200	129,060.00	0.11
331	688578	艾力斯	4,781	128,847.95	0.11
332	300623	捷捷微电	7,100	128,652.00	0.11
333	002038	双鹭药业	12,700	128,143.00	0.10
334	688091	上海谊众	1,740	128,116.20	0.10
335	603306	华懋科技	4,400	127,688.00	0.10
336	600320	振华重工	34,200	127,566.00	0.10
337	300171	东富龙	5,600	127,400.00	0.10
338	601890	亚星锚链	11,000	127,380.00	0.10
339	000650	仁和药业	20,700	127,098.00	0.10
340	603505	金石资源	5,436	126,930.60	0.10
341	600185	格力地产	18,500	126,910.00	0.10
342	002061	浙江交科	28,420	126,753.20	0.10
343	002960	青鸟消防	6,930	126,195.30	0.10
344	300685	艾德生物	5,200	126,152.00	0.10

345	601126	四方股份	8,300	126,077.00	0.10
346	601519	大智慧	17,600	126,016.00	0.10
347	300587	天铁股份	16,351	125,902.70	0.10
348	603128	华贸物流	13,800	125,718.00	0.10
349	000676	智度股份	17,900	125,479.00	0.10
350	300271	华宇软件	11,300	125,204.00	0.10
351	600720	祁连山	11,000	125,070.00	0.10
352	601860	紫金银行	49,700	124,747.00	0.10
353	600064	南京高科	18,800	124,268.00	0.10
354	688711	宏微科技	2,127	124,089.18	0.10
355	002581	未名医药	6,500	124,085.00	0.10
356	000969	安泰科技	13,100	124,057.00	0.10
357	600248	陕西建工	25,900	123,543.00	0.10
358	603008	喜临门	4,900	123,382.00	0.10
359	601137	博威合金	7,900	122,924.00	0.10
360	300762	上海瀚讯	10,420	122,643.40	0.10
361	300398	飞凯材料	7,100	122,049.00	0.10
362	600552	凯盛科技	10,300	121,952.00	0.10
363	300323	华灿光电	17,800	121,930.00	0.10
364	600266	城建发展	24,000	121,920.00	0.10
365	000811	冰轮环境	7,700	121,352.00	0.10
366	688676	金盘科技	3,988	120,796.52	0.10
367	605090	九丰能源	5,400	120,582.00	0.10
368	688686	奥普特	733	120,563.84	0.10
369	603100	川仪股份	3,100	120,466.00	0.10
370	000090	天健集团	23,900	120,456.00	0.10
371	002233	塔牌集团	15,600	120,432.00	0.10
372	002467	二六三	24,100	119,777.00	0.10
373	600428	中远海特	19,000	119,700.00	0.10
374	301071	力量钻石	2,720	119,680.00	0.10
375	600123	兰花科创	14,590	119,346.20	0.10
376	600285	羚锐制药	7,400	118,844.00	0.10
377	688389	普门科技	5,051	118,647.99	0.10
378	000657	中钨高新	12,210	118,314.90	0.10
379	603393	新天然气	4,400	118,096.00	0.10
380	600252	中恒集团	47,700	117,819.00	0.10
381	600577	精达股份	27,900	117,738.00	0.10
382	300811	铂科新材	1,980	117,691.20	0.10
383	002237	恒邦股份	10,800	117,612.00	0.10
384	002002	鸿达兴业	52,400	117,376.00	0.10
385	688696	极米科技	841	117,226.99	0.10
386	603108	润达医疗	6,300	117,054.00	0.10
387	002400	省广集团	24,300	116,883.00	0.10

388	002216	三全食品	7,500	116,850.00	0.10
389	002171	楚江新材	16,400	116,768.00	0.10
390	002428	云南锗业	9,600	116,736.00	0.10
391	688100	威胜信息	3,909	116,527.29	0.10
392	000982	中银绒业	76,600	116,432.00	0.10
393	300725	药石科技	2,400	116,232.00	0.10
394	300087	荃银高科	11,240	116,221.60	0.10
395	002214	大立科技	8,500	116,025.00	0.10
396	600688	上海石化	37,300	116,003.00	0.10
397	600277	亿利洁能	35,800	115,992.00	0.10
398	300348	长亮科技	11,100	115,884.00	0.09
399	600098	广州发展	18,700	115,566.00	0.09
400	300470	中密控股	2,500	115,550.00	0.09
401	000582	北部湾港	15,200	115,520.00	0.09
402	600477	杭萧钢构	28,200	115,338.00	0.09
403	601952	苏垦农发	9,900	115,236.00	0.09
404	601918	新集能源	27,100	115,175.00	0.09
405	000758	中色股份	24,400	115,168.00	0.09
406	000829	天音控股	12,700	114,808.00	0.09
407	600459	贵研铂业	7,500	114,750.00	0.09
408	601949	中国出版	9,700	114,460.00	0.09
409	300855	图南股份	3,240	114,436.80	0.09
410	000966	长源电力	20,500	114,390.00	0.09
411	000685	中山公用	15,100	114,307.00	0.09
412	601777	力帆科技	32,000	114,240.00	0.09
413	000902	新洋丰	11,100	114,108.00	0.09
414	300233	金城医药	6,000	114,060.00	0.09
415	600888	新疆众和	14,400	114,048.00	0.09
416	600776	东方通信	8,000	114,000.00	0.09
417	600740	山西焦化	22,200	113,886.00	0.09
418	002060	粤水电	17,300	113,834.00	0.09
419	600621	华鑫股份	10,700	113,741.00	0.09
420	300224	正海磁材	8,800	113,168.00	0.09
421	000913	钱江摩托	6,200	113,026.00	0.09
422	002163	海南发展	11,300	113,000.00	0.09
423	600389	江山股份	4,750	112,812.50	0.09
424	600331	宏达股份	23,800	112,812.00	0.09
425	002726	龙大美食	13,600	112,744.00	0.09
426	603906	龙蟠科技	6,200	112,530.00	0.09
427	000901	航天科技	10,500	112,350.00	0.09
428	300841	康华生物	1,700	112,013.00	0.09
429	600420	国药现代	9,900	111,771.00	0.09
430	000539	粤电力 A	15,300	111,690.00	0.09

431	688166	博瑞医药	5,079	111,687.21	0.09
432	002390	信邦制药	25,200	111,636.00	0.09
433	301047	义翘神州	1,300	111,410.00	0.09
434	688575	亚辉龙	6,037	111,382.65	0.09
435	600059	古越龙山	10,700	111,066.00	0.09
436	002626	金达威	5,900	110,861.00	0.09
437	300598	诚迈科技	2,400	110,808.00	0.09
438	600216	浙江医药	10,100	110,595.00	0.09
439	300856	科思股份	1,400	110,278.00	0.09
440	300827	上能电气	3,059	110,276.95	0.09
441	600996	贵广网络	11,200	109,984.00	0.09
442	688798	艾为电子	1,859	109,959.85	0.09
443	000851	高鸿股份	20,200	109,888.00	0.09
444	300738	奥飞数据	10,772	109,874.40	0.09
445	688383	新益昌	789	109,844.58	0.09
446	002258	利尔化学	8,500	109,735.00	0.09
447	600210	紫江企业	20,600	109,592.00	0.09
448	601311	骆驼股份	11,800	109,504.00	0.09
449	300027	华谊兄弟	39,200	109,368.00	0.09
450	002239	奥特佳	40,900	109,203.00	0.09
451	605123	派克新材	1,000	108,650.00	0.09
452	600305	恒顺醋业	10,000	108,600.00	0.09
453	600635	大众公用	32,700	108,564.00	0.09
454	603197	保隆科技	2,000	108,500.00	0.09
455	002967	广电计量	5,400	108,486.00	0.09
456	600502	安徽建工	20,500	108,240.00	0.09
457	600717	天津港	24,400	108,092.00	0.09
458	603043	广州酒家	3,800	107,388.00	0.09
459	300463	迈克生物	7,100	107,352.00	0.09
460	300726	宏达电子	2,400	107,328.00	0.09
461	000767	晋控电力	33,800	107,146.00	0.09
462	000059	华锦股份	17,000	106,930.00	0.09
463	002023	海特高新	11,600	106,720.00	0.09
464	000923	河钢资源	7,900	106,650.00	0.09
465	600645	中源协和	6,300	106,470.00	0.09
466	300443	金雷股份	3,000	106,350.00	0.09
467	600496	精工钢构	28,500	106,305.00	0.09
468	002051	中工国际	8,900	106,177.00	0.09
469	002906	华阳集团	3,100	105,989.00	0.09
470	000627	天茂集团	35,300	105,900.00	0.09
471	000915	华特达因	3,000	105,870.00	0.09
472	600773	西藏城投	8,400	105,840.00	0.09
473	000488	晨鸣纸业	21,800	105,730.00	0.09

474	688277	天智航	5,730	105,661.20	0.09
475	000928	中钢国际	10,900	105,185.00	0.09
476	002108	沧州明珠	23,200	105,096.00	0.09
477	300366	创意信息	8,500	105,060.00	0.09
478	603118	共进股份	7,900	104,991.00	0.09
479	300151	昌红科技	5,800	104,980.00	0.09
480	300123	亚光科技	14,400	104,832.00	0.09
481	600612	老凤祥	1,500	104,820.00	0.09
482	603881	数据港	4,640	104,817.60	0.09
483	002453	华软科技	9,800	104,762.00	0.09
484	000735	罗牛山	16,000	104,640.00	0.09
485	002124	天邦食品	23,000	104,420.00	0.09
486	002539	云图控股	11,600	104,168.00	0.09
487	688202	美迪西	1,220	104,005.00	0.09
488	603612	索通发展	6,000	103,980.00	0.09
489	601369	陕鼓动力	11,400	103,854.00	0.09
490	300428	立中集团	4,500	103,770.00	0.09
491	600729	重庆百货	3,300	103,752.00	0.09
492	601963	重庆银行	13,100	103,621.00	0.08
493	301087	可孚医疗	2,100	103,530.00	0.08
494	300737	科顺股份	11,300	103,508.00	0.08
495	601200	上海环境	10,900	103,441.00	0.08
496	300131	英唐智控	19,700	103,425.00	0.08
497	688232	新点软件	1,920	103,315.20	0.08
498	300263	隆华科技	12,400	103,168.00	0.08
499	300409	道氏技术	8,200	103,074.00	0.08
500	000727	冠捷科技	48,600	103,032.00	0.08
501	002537	海联金汇	15,300	102,969.00	0.08
502	600246	万通发展	18,000	102,960.00	0.08
503	688131	皓元医药	1,806	102,905.88	0.08
504	603595	东尼电子	2,400	102,768.00	0.08
505	002859	洁美科技	3,700	102,490.00	0.08
506	600313	农发种业	11,900	102,459.00	0.08
507	000049	德赛电池	2,900	102,312.00	0.08
508	603323	苏农银行	24,300	102,303.00	0.08
509	002488	金固股份	14,800	102,120.00	0.08
510	603033	三维股份	5,010	101,953.50	0.08
511	300352	北信源	20,200	101,808.00	0.08
512	300910	瑞丰新材	2,020	101,606.00	0.08
513	002583	海能达	17,400	101,094.00	0.08
514	002041	登海种业	6,600	100,782.00	0.08
515	688123	聚辰股份	1,872	100,563.84	0.08
516	300634	彩讯股份	3,800	100,320.00	0.08

517	600882	妙可蓝多	4,500	100,260.00	0.08
518	300319	麦捷科技	11,700	100,152.00	0.08
519	000688	国城矿业	6,600	100,122.00	0.08
520	300358	楚天科技	6,700	100,031.00	0.08
521	603171	税友股份	2,500	99,950.00	0.08
522	600835	上海机电	5,800	99,644.00	0.08
523	600811	东方集团	44,400	99,456.00	0.08
524	300007	汉威科技	4,700	99,405.00	0.08
525	600490	鹏欣资源	27,000	99,360.00	0.08
526	301095	广立微	1,200	99,180.00	0.08
527	002639	雪人股份	11,900	99,127.00	0.08
528	603801	志邦家居	3,000	99,060.00	0.08
529	688048	长光华芯	1,040	98,300.80	0.08
530	002003	伟星股份	10,500	98,280.00	0.08
531	002498	汉缆股份	24,500	98,245.00	0.08
532	603169	兰石重装	13,200	98,208.00	0.08
533	000600	建投能源	12,700	98,171.00	0.08
534	603018	华设集团	11,200	98,000.00	0.08
535	600017	日照港	32,600	97,474.00	0.08
536	688789	宏华数科	1,103	97,427.99	0.08
537	603533	掌阅科技	3,500	97,020.00	0.08
538	002191	劲嘉股份	16,100	96,922.00	0.08
539	600328	中盐化工	10,760	96,840.00	0.08
540	600366	宁波韵升	10,900	96,683.00	0.08
541	003021	兆威机电	1,100	96,503.00	0.08
542	000712	锦龙股份	7,700	96,096.00	0.08
543	002416	爱施德	13,000	95,940.00	0.08
544	300973	立高食品	1,400	95,788.00	0.08
545	300497	富祥药业	7,500	95,700.00	0.08
546	603636	南威软件	6,500	95,355.00	0.08
547	000016	深康佳 A	20,200	95,344.00	0.08
548	600491	龙元建设	18,900	95,256.00	0.08
549	603888	新华网	2,900	95,178.00	0.08
550	300663	科蓝软件	7,000	95,130.00	0.08
551	600531	豫光金铅	15,100	95,130.00	0.08
552	300887	谱尼测试	2,400	94,992.00	0.08
553	000848	承德露露	10,700	94,695.00	0.08
554	603105	芯能科技	5,600	94,584.00	0.08
555	688318	财富趋势	946	94,571.62	0.08
556	600675	中华企业	32,000	94,400.00	0.08
557	002283	天润工业	14,700	94,374.00	0.08
558	601619	嘉泽新能	20,700	94,185.00	0.08
559	002611	东方精工	16,400	94,136.00	0.08

560	688261	东微半导	672	93,992.64	0.08
561	603766	隆鑫通用	17,800	93,984.00	0.08
562	002434	万里扬	10,500	93,975.00	0.08
563	002421	达实智能	26,600	93,632.00	0.08
564	002243	力合科创	11,000	93,610.00	0.08
565	300377	赢时胜	11,500	93,150.00	0.08
566	600864	哈投股份	18,200	93,002.00	0.08
567	603566	普莱柯	4,000	93,000.00	0.08
568	688148	芳源股份	7,611	92,854.20	0.08
569	002635	安洁科技	6,700	92,460.00	0.08
570	688326	经纬恒润	640	92,409.60	0.08
571	002226	江南化工	18,200	92,274.00	0.08
572	600360	华微电子	13,400	92,192.00	0.08
573	603187	海容冷链	4,600	91,954.00	0.08
574	000927	中国铁物	33,000	91,740.00	0.08
575	600295	鄂尔多斯	10,200	91,494.00	0.07
576	300772	运达股份	7,100	91,448.00	0.07
577	688298	东方生物	2,424	91,433.28	0.07
578	600125	铁龙物流	15,100	91,204.00	0.07
579	001269	欧晶科技	1,240	91,177.20	0.07
580	301080	百普赛斯	1,450	91,089.00	0.07
581	002215	诺普信	12,100	90,871.00	0.07
582	001270	铖昌科技	1,040	90,792.00	0.07
583	300119	瑞普生物	5,100	90,780.00	0.07
584	300765	新诺威	7,020	90,487.80	0.07
585	300039	上海凯宝	13,100	90,390.00	0.07
586	002612	朗姿股份	3,800	90,364.00	0.07
587	600223	鲁商发展	8,800	90,288.00	0.07
588	601606	长城军工	6,600	90,222.00	0.07
589	002106	莱宝高科	10,600	90,100.00	0.07
590	600742	一汽富维	11,000	90,090.00	0.07
591	301219	腾远钴业	2,410	90,037.60	0.07
592	300671	富满微	2,200	89,892.00	0.07
593	002158	汉钟精机	3,600	89,856.00	0.07
594	603212	赛伍技术	4,300	89,483.00	0.07
595	000795	英洛华	11,800	89,444.00	0.07
596	600391	航发科技	3,700	89,207.00	0.07
597	300180	华峰超纤	24,700	89,167.00	0.07
598	301239	普瑞眼科	900	88,272.00	0.07
599	688586	江航装备	6,343	88,231.13	0.07
600	000567	海德股份	6,880	88,201.60	0.07
601	002697	红旗连锁	15,100	88,184.00	0.07
602	600682	南京新百	11,000	88,110.00	0.07

603	002068	黑猫股份	7,400	87,838.00	0.07
604	002097	山河智能	13,200	87,780.00	0.07
605	300158	振东制药	15,300	87,669.00	0.07
606	688526	科前生物	3,672	87,356.88	0.07
607	600971	恒源煤电	11,200	87,248.00	0.07
608	600812	华北制药	15,600	87,204.00	0.07
609	300770	新媒股份	1,900	87,134.00	0.07
610	601019	山东出版	9,500	87,115.00	0.07
611	000557	西部创业	16,500	86,955.00	0.07
612	603567	珍宝岛	5,800	86,768.00	0.07
613	002895	川恒股份	4,400	86,680.00	0.07
614	688198	佰仁医疗	815	86,479.65	0.07
615	002948	青岛银行	27,600	86,388.00	0.07
616	000801	四川九洲	11,800	86,140.00	0.07
617	000036	华联控股	20,900	86,108.00	0.07
618	002573	清新环境	15,600	85,956.00	0.07
619	600649	城投控股	21,800	85,674.00	0.07
620	300102	乾照光电	13,000	85,540.00	0.07
621	600775	南京熊猫	7,900	85,241.00	0.07
622	688356	键凯科技	800	85,240.00	0.07
623	002017	东信和平	6,490	85,083.90	0.07
624	601011	宝泰隆	23,700	85,083.00	0.07
625	301078	孩子王	7,400	84,582.00	0.07
626	002218	拓日新能	17,600	84,480.00	0.07
627	001301	尚太科技	1,500	84,465.00	0.07
628	600639	浦东金桥	6,800	84,388.00	0.07
629	001696	宗申动力	11,900	84,252.00	0.07
630	600966	博汇纸业	14,200	84,064.00	0.07
631	601028	玉龙股份	7,800	83,850.00	0.07
632	600075	新疆天业	17,800	83,838.00	0.07
633	002959	小熊电器	1,000	83,500.00	0.07
634	002556	辉隆股份	11,500	83,490.00	0.07
635	688508	芯朋微	1,439	83,447.61	0.07
636	000603	盛达资源	6,900	83,421.00	0.07
637	002048	宁波华翔	6,200	83,080.00	0.07
638	002987	京北方	3,780	82,857.60	0.07
639	002929	润建股份	1,900	82,479.00	0.07
640	300455	航天智装	7,200	82,440.00	0.07
641	300085	银之杰	7,000	82,320.00	0.07
642	603032	德新科技	2,380	82,205.20	0.07
643	300284	苏交科	13,700	82,200.00	0.07
644	300761	立华股份	4,460	82,197.80	0.07
645	600108	亚盛集团	27,200	82,144.00	0.07

646	000950	重药控股	12,200	82,106.00	0.07
647	600335	国机汽车	7,200	82,080.00	0.07
648	002489	浙江永强	20,200	81,810.00	0.07
649	300382	斯莱克	6,200	81,778.00	0.07
650	002206	海利得	15,200	81,472.00	0.07
651	300206	理邦仪器	5,400	81,432.00	0.07
652	002733	雄韬股份	4,700	81,263.00	0.07
653	002055	得润电子	8,500	81,260.00	0.07
654	300696	爱乐达	3,300	81,180.00	0.07
655	300953	震裕科技	1,100	80,993.00	0.07
656	002274	华昌化工	10,800	80,892.00	0.07
657	601528	瑞丰银行	16,670	80,849.50	0.07
658	002101	广东鸿图	4,100	80,278.00	0.07
659	300630	普利制药	4,100	80,155.00	0.07
660	002234	民和股份	4,400	80,124.00	0.07
661	002440	闰土股份	12,000	80,040.00	0.07
662	300055	万邦达	11,100	79,920.00	0.07
663	300821	东岳硅材	8,200	79,868.00	0.07
664	300527	中船应急	8,400	79,800.00	0.07
665	002545	东方铁塔	11,300	79,778.00	0.07
666	002550	千红制药	15,400	79,464.00	0.07
667	600929	雪天盐业	10,000	79,400.00	0.07
668	600449	宁夏建材	5,100	79,356.00	0.07
669	601801	皖新传媒	8,400	78,876.00	0.06
670	002135	东南网架	12,200	78,812.00	0.06
671	600610	中毅达	6,800	78,812.00	0.06
672	600710	苏美达	9,200	78,752.00	0.06
673	603396	金辰股份	1,200	78,720.00	0.06
674	605507	国邦医药	3,700	78,699.00	0.06
675	300639	凯普生物	7,850	78,657.00	0.06
676	600480	凌云股份	10,000	78,600.00	0.06
677	002928	华夏航空	9,300	78,585.00	0.06
678	688733	壹石通	2,538	78,576.48	0.06
679	002349	精华制药	8,700	78,561.00	0.06
680	002043	兔宝宝	7,200	78,552.00	0.06
681	603489	八方股份	1,120	78,534.40	0.06
682	000672	上峰水泥	8,600	78,518.00	0.06
683	002815	崇达技术	6,300	78,435.00	0.06
684	000552	甘肃能化	23,500	78,255.00	0.06
685	002993	奥海科技	2,300	78,016.00	0.06
686	000756	新华制药	3,600	77,688.00	0.06
687	300723	一品红	2,650	77,645.00	0.06
688	002367	康力电梯	8,500	77,605.00	0.06

689	603919	金徽酒	3,300	77,484.00	0.06
690	000652	泰达股份	18,800	77,456.00	0.06
691	600073	上海梅林	10,600	77,380.00	0.06
692	300653	正海生物	2,250	77,377.50	0.06
693	300596	利安隆	1,900	77,273.00	0.06
694	603466	风语筑	5,550	77,145.00	0.06
695	600163	中闽能源	13,800	77,004.00	0.06
696	002125	湘潭电化	6,100	76,921.00	0.06
697	688238	和元生物	6,812	76,907.48	0.06
698	300080	易成新能	15,100	76,859.00	0.06
699	600458	时代新材	6,400	76,736.00	0.06
700	601702	华峰铝业	5,600	76,608.00	0.06
701	000560	我爱我家	28,900	76,585.00	0.06
702	600770	综艺股份	13,600	76,568.00	0.06
703	600789	鲁抗医药	11,900	76,398.00	0.06
704	002913	奥士康	2,000	76,360.00	0.06
705	600508	上海能源	5,200	76,336.00	0.06
706	688085	三友医疗	2,906	76,311.56	0.06
707	300768	迪普科技	4,600	76,222.00	0.06
708	000612	焦作万方	15,600	75,504.00	0.06
709	603985	恒润股份	3,600	75,492.00	0.06
710	000990	诚志股份	9,900	75,438.00	0.06
711	002194	武汉凡谷	6,900	75,417.00	0.06
712	603896	寿仙谷	1,700	75,310.00	0.06
713	300477	合纵科技	16,100	75,187.00	0.06
714	000088	盐田港	15,500	75,175.00	0.06
715	603010	万盛股份	6,900	75,003.00	0.06
716	000718	苏宁环球	27,400	74,802.00	0.06
717	000498	山东路桥	11,600	74,472.00	0.06
718	600172	黄河旋风	17,400	74,472.00	0.06
719	600751	海航科技	31,300	74,181.00	0.06
720	002759	天际股份	5,300	74,094.00	0.06
721	002746	仙坛股份	9,400	74,072.00	0.06
722	301165	锐捷网络	1,200	74,064.00	0.06
723	688268	华特气体	916	73,948.68	0.06
724	603098	森特股份	3,600	73,800.00	0.06
725	601929	吉视传媒	40,100	73,784.00	0.06
726	600783	鲁信创投	5,700	73,701.00	0.06
727	601882	海天精工	2,200	73,260.00	0.06
728	000736	中交地产	5,100	73,185.00	0.06
729	301267	华夏眼科	1,200	73,140.00	0.06
730	603387	基蛋生物	5,636	72,648.04	0.06
731	000006	深振业 A	16,600	72,542.00	0.06

732	002204	大连重工	14,100	72,474.00	0.06
733	002549	凯美特气	6,300	72,450.00	0.06
734	603959	百利科技	6,300	72,450.00	0.06
735	605020	永和股份	2,800	72,268.00	0.06
736	605376	博迁新材	2,300	72,174.00	0.06
737	300401	花园生物	6,200	72,044.00	0.06
738	600643	爱建集团	14,400	72,000.00	0.06
739	688206	概伦电子	2,560	71,782.40	0.06
740	300267	尔康制药	22,200	71,706.00	0.06
741	600217	中再资环	15,000	71,550.00	0.06
742	301216	万凯新材	4,300	71,509.00	0.06
743	002646	天佑德酒	5,300	71,497.00	0.06
744	603229	奥翔药业	3,400	71,332.00	0.06
745	002979	雷赛智能	3,000	71,280.00	0.06
746	600211	西藏药业	1,200	71,280.00	0.06
747	301308	江波龙	700	71,232.00	0.06
748	002941	新疆交建	4,600	71,208.00	0.06
749	603328	依顿电子	8,600	71,208.00	0.06
750	301238	瑞泰新材	3,500	71,190.00	0.06
751	300869	康泰医学	3,100	71,176.00	0.06
752	000566	海南海药	14,200	71,000.00	0.06
753	002741	光华科技	4,200	70,896.00	0.06
754	603730	岱美股份	4,485	70,863.00	0.06
755	601609	金田股份	10,900	70,741.00	0.06
756	603871	嘉友国际	4,500	70,695.00	0.06
757	600169	太原重工	28,500	70,680.00	0.06
758	300143	盈康生命	6,200	70,308.00	0.06
759	603416	信捷电气	1,700	70,227.00	0.06
760	603348	文灿股份	1,600	70,096.00	0.06
761	000061	农产品	11,700	70,083.00	0.06
762	688366	昊海生科	832	70,071.04	0.06
763	000546	金圆股份	11,000	70,070.00	0.06
764	603936	博敏电子	5,800	69,600.00	0.06
765	600308	华泰股份	18,680	69,489.60	0.06
766	002320	海峡股份	11,500	69,460.00	0.06
767	600340	华夏幸福	31,400	69,394.00	0.06
768	600575	淮河能源	27,100	69,376.00	0.06
769	300607	拓斯达	4,600	69,138.00	0.06
770	688776	国光电气	833	69,039.04	0.06
771	002307	北新路桥	13,800	69,000.00	0.06
772	002664	信质集团	4,900	68,992.00	0.06
773	603733	仙鹤股份	3,300	68,805.00	0.06
774	600284	浦东建设	11,200	68,544.00	0.06

775	000881	中广核技	8,300	68,309.00	0.06
776	600810	神马股份	9,600	68,256.00	0.06
777	301089	拓新药业	1,100	68,134.00	0.06
778	688499	利元亨	1,071	68,029.92	0.06
779	600955	维远股份	3,500	68,005.00	0.06
780	603113	金能科技	8,400	67,956.00	0.06
781	603915	国茂股份	3,200	67,776.00	0.06
782	603666	亿嘉和	1,500	67,725.00	0.06
783	688315	诺禾致源	2,542	67,490.10	0.06
784	002645	华宏科技	5,500	67,430.00	0.06
785	000935	四川双马	4,000	67,360.00	0.06
786	002840	华统股份	4,300	67,252.00	0.06
787	300662	科锐国际	1,900	67,203.00	0.06
788	003012	东鹏控股	8,300	67,147.00	0.06
789	001213	中铁特货	15,200	67,032.00	0.05
790	002461	珠江啤酒	7,600	66,956.00	0.05
791	688127	蓝特光学	3,770	66,465.10	0.05
792	000048	京基智农	3,400	66,368.00	0.05
793	300735	光弘科技	6,200	66,340.00	0.05
794	601921	浙版传媒	7,600	66,044.00	0.05
795	002314	南山控股	20,000	66,000.00	0.05
796	000789	万年青	8,500	65,875.00	0.05
797	600058	五矿发展	6,700	65,861.00	0.05
798	601886	江河集团	7,400	65,786.00	0.05
799	002589	瑞康医药	19,300	65,620.00	0.05
800	600657	信达地产	15,500	65,565.00	0.05
801	603609	禾丰股份	7,200	65,520.00	0.05
802	000968	蓝焰控股	8,600	65,016.00	0.05
803	002302	西部建设	9,100	64,974.00	0.05
804	603281	江瀚新材	2,100	64,848.00	0.05
805	600662	外服控股	11,300	64,636.00	0.05
806	601015	陕西黑猫	14,600	64,532.00	0.05
807	603920	世运电路	3,300	64,449.00	0.05
808	002310	东方园林	37,900	64,430.00	0.05
809	300183	东软载波	3,900	64,389.00	0.05
810	002242	九阳股份	4,300	64,285.00	0.05
811	601069	西部黄金	5,000	64,200.00	0.05
812	603363	傲农生物	7,000	64,190.00	0.05
813	000828	东莞控股	7,000	64,050.00	0.05
814	301217	铜冠铜箔	4,500	64,035.00	0.05
815	600997	开滦股份	10,700	63,879.00	0.05
816	601515	东风股份	14,580	63,860.40	0.05
817	300894	火星人	2,500	63,850.00	0.05

818	301015	百洋医药	2,300	63,848.00	0.05
819	002534	西子洁能	3,800	63,840.00	0.05
820	600006	东风汽车	10,800	63,828.00	0.05
821	300134	大富科技	6,200	63,550.00	0.05
822	600550	保变电气	12,600	63,504.00	0.05
823	002516	旷达科技	13,100	63,404.00	0.05
824	300767	震安科技	2,500	63,400.00	0.05
825	600874	创业环保	10,800	63,288.00	0.05
826	600691	阳煤化工	19,900	62,685.00	0.05
827	688337	普源精电	1,040	62,670.40	0.05
828	000885	城发环境	4,700	62,557.00	0.05
829	603583	捷昌驱动	2,900	62,466.00	0.05
830	605009	豪悦护理	1,300	62,400.00	0.05
831	002190	成飞集成	2,800	61,992.00	0.05
832	688699	明微电子	1,231	61,943.92	0.05
833	002991	甘源食品	800	61,360.00	0.05
834	002201	正威新材	6,420	61,054.20	0.05
835	603060	国检集团	5,780	60,458.80	0.05
836	003009	中天火箭	1,000	60,250.00	0.05
837	002267	陕天然气	7,600	60,192.00	0.05
838	688368	晶丰明源	470	59,788.70	0.05
839	301206	三元生物	1,700	59,483.00	0.05
840	002810	山东赫达	3,300	59,400.00	0.05
841	600787	中储股份	11,000	59,290.00	0.05
842	002088	鲁阳节能	3,200	59,008.00	0.05
843	600984	建设机械	13,030	58,895.60	0.05
844	603299	苏盐井神	5,900	58,882.00	0.05
845	002990	盛视科技	1,600	58,880.00	0.05
846	002481	双塔食品	13,200	58,872.00	0.05
847	300602	飞荣达	3,800	58,862.00	0.05
848	301069	凯盛新材	2,300	58,512.00	0.05
849	603123	翠微股份	6,000	58,440.00	0.05
850	300900	广联航空	2,000	57,620.00	0.05
851	603718	海利生物	6,100	57,523.00	0.05
852	603719	良品铺子	2,300	57,523.00	0.05
853	600523	贵航股份	4,000	57,440.00	0.05
854	600007	中国国贸	3,100	57,412.00	0.05
855	300208	青岛中程	6,900	57,132.00	0.05
856	002435	长江健康	11,700	56,979.00	0.05
857	002034	旺能环境	3,600	56,916.00	0.05
858	300191	潜能恒信	3,100	56,668.00	0.05
859	000791	甘肃能源	10,800	56,484.00	0.05
860	600184	光电股份	4,300	56,459.00	0.05

861	688330	宏力达	1,600	56,128.00	0.05
862	000597	东北制药	10,800	56,052.00	0.05
863	603297	永新光学	700	55,930.00	0.05
864	002285	世联行	21,700	55,552.00	0.05
865	301327	华宝新能	700	55,377.00	0.05
866	600604	市北高新	11,800	55,224.00	0.05
867	600581	八一钢铁	13,600	55,080.00	0.05
868	688173	希荻微	2,400	54,912.00	0.04
869	300091	金通灵	18,400	54,832.00	0.04
870	002978	安宁股份	1,700	54,587.00	0.04
871	601700	风范股份	10,200	54,162.00	0.04
872	603520	司太立	3,220	53,709.60	0.04
873	000761	本钢板材	13,300	53,200.00	0.04
874	605338	巴比食品	2,100	53,025.00	0.04
875	603429	集友股份	5,980	52,982.80	0.04
876	000737	北方铜业	9,800	52,822.00	0.04
877	003040	楚天龙	2,900	52,606.00	0.04
878	603995	甬金股份	2,200	52,602.00	0.04
879	300792	壹网壹创	1,900	52,383.00	0.04
880	603208	江山欧派	1,430	52,080.60	0.04
881	300579	数字认证	1,800	52,020.00	0.04
882	688660	电气风电	9,325	51,940.25	0.04
883	000517	荣安地产	16,900	51,545.00	0.04
884	000062	深圳华强	4,500	51,390.00	0.04
885	603055	台华新材	4,600	51,106.00	0.04
886	002344	海宁皮城	10,800	51,084.00	0.04
887	600648	外高桥	4,500	50,895.00	0.04
888	688233	神工股份	1,603	50,622.74	0.04
889	603301	振德医疗	1,700	50,354.00	0.04
890	600746	江苏索普	7,700	50,281.00	0.04
891	300860	锋尚文化	900	49,896.00	0.04
892	002636	金安国纪	5,400	49,842.00	0.04
893	002677	浙江美大	4,700	49,773.00	0.04
894	300204	舒泰神	5,000	49,750.00	0.04
895	002641	公元股份	8,800	49,632.00	0.04
896	002378	章源钨业	8,510	49,528.20	0.04
897	600876	凯盛新能	3,100	49,476.00	0.04
898	301090	华润材料	3,900	49,218.00	0.04
899	002782	可立克	3,200	48,928.00	0.04
900	600990	四创电子	1,540	48,725.60	0.04
901	603983	丸美股份	1,500	48,525.00	0.04
902	603989	艾华集团	2,300	48,438.00	0.04
903	603601	再升科技	11,340	48,421.80	0.04

904	001258	立新能源	5,100	48,399.00	0.04
905	002891	中宠股份	2,000	48,280.00	0.04
906	002053	云南能投	4,300	48,246.00	0.04
907	000019	深粮控股	6,500	48,230.00	0.04
908	603877	太平鸟	1,900	48,032.00	0.04
909	688161	威高骨科	1,105	47,857.55	0.04
910	002950	奥美医疗	4,600	47,748.00	0.04
911	301175	中科环保	7,600	47,348.00	0.04
912	300702	天宇股份	1,940	47,083.80	0.04
913	000550	江铃汽车	3,400	47,056.00	0.04
914	002838	道恩股份	2,800	47,040.00	0.04
915	688153	唯捷创芯	640	46,822.40	0.04
916	688190	云路股份	640	46,720.00	0.04
917	002651	利君股份	6,000	46,620.00	0.04
918	301207	华兰疫苗	1,400	46,564.00	0.04
919	601101	昊华能源	8,000	46,560.00	0.04
920	000030	富奥股份	9,200	46,368.00	0.04
921	600400	红豆股份	14,000	45,920.00	0.04
922	000029	深深房 A	4,200	45,402.00	0.04
923	003032	传智教育	3,100	45,167.00	0.04
924	601330	绿色动力	6,100	45,079.00	0.04
925	000813	德展健康	15,300	44,982.00	0.04
926	300783	三只松鼠	2,300	44,942.00	0.04
927	003006	百亚股份	2,600	44,928.00	0.04
928	688399	硕世生物	810	44,712.00	0.04
929	301367	怡和嘉业	300	44,502.00	0.04
930	688001	华兴源创	1,248	44,204.16	0.04
931	300485	赛升药业	4,300	43,989.00	0.04
932	603916	苏博特	3,300	43,692.00	0.04
933	003039	顺控发展	2,500	42,400.00	0.03
934	600696	岩石股份	1,700	42,313.00	0.03
935	603025	大豪科技	3,420	42,271.20	0.03
936	000025	特力 A	2,300	42,021.00	0.03
937	001308	康冠科技	1,530	42,013.80	0.03
938	603938	三孚股份	2,120	41,954.80	0.03
939	002932	明德生物	1,600	41,424.00	0.03
940	688128	中国电研	1,621	41,335.50	0.03
941	002768	国恩股份	1,700	41,123.00	0.03
942	603439	贵州三力	2,400	40,944.00	0.03
943	600510	黑牡丹	6,600	40,062.00	0.03
944	301171	易点天下	1,800	39,780.00	0.03
945	301060	兰卫医学	2,300	39,767.00	0.03
946	605369	拱东医疗	700	39,228.00	0.03

947	001338	永顺泰	2,100	38,724.00	0.03
948	600935	华塑股份	10,300	38,625.00	0.03
949	002918	蒙娜丽莎	2,500	38,600.00	0.03
950	605007	五洲特纸	2,500	37,900.00	0.03
951	605199	葫芦娃	2,500	37,850.00	0.03
952	600569	安阳钢铁	19,000	37,810.00	0.03
953	002946	新乳业	2,600	37,310.00	0.03
954	002911	佛燃能源	2,900	37,294.00	0.03
955	300981	中红医疗	2,430	36,814.50	0.03
956	600370	三房巷	13,500	36,180.00	0.03
957	300755	华致酒行	1,600	35,952.00	0.03
958	301200	大族数控	900	35,892.00	0.03
959	002724	海洋王	4,100	35,588.00	0.03
960	603693	江苏新能	2,520	35,280.00	0.03
961	002695	煌上煌	3,300	35,277.00	0.03
962	000058	深赛格	5,700	35,226.00	0.03
963	301363	美好医疗	800	35,192.00	0.03
964	603071	物产环能	2,100	34,839.00	0.03
965	600841	动力新科	5,700	34,770.00	0.03
966	301177	迪阿股份	900	34,587.00	0.03
967	600403	大有能源	8,300	34,113.00	0.03
968	301268	铭利达	800	33,496.00	0.03
969	001322	箭牌家居	2,000	33,480.00	0.03
970	002287	奇正藏药	1,400	33,460.00	0.03
971	301301	川宁生物	3,707	33,214.72	0.03
972	603013	亚普股份	2,100	32,928.00	0.03
973	600618	氯碱化工	3,600	32,292.00	0.03
974	000011	深物业 A	3,400	31,586.00	0.03
975	603235	天新药业	1,000	31,360.00	0.03
976	600903	贵州燃气	3,600	31,140.00	0.03
977	605222	起帆电缆	1,500	30,990.00	0.03
978	001236	弘业期货	2,000	30,660.00	0.03
979	001323	慕思股份	900	30,564.00	0.03
980	605388	均瑶健康	2,400	30,504.00	0.02
981	605296	神农集团	1,400	29,988.00	0.02
982	601068	中铝国际	5,500	29,480.00	0.02
983	603093	南华期货	2,700	29,403.00	0.02
984	603530	神马电力	1,800	27,990.00	0.02
985	603103	横店影视	1,600	26,944.00	0.02
986	605333	沪光股份	1,600	26,464.00	0.02
987	300942	易瑞生物	2,100	26,229.00	0.02
988	603053	成都燃气	2,600	26,182.00	0.02
989	603132	金徽股份	2,200	24,948.00	0.02

990	002961	瑞达期货	1,700	24,497.00	0.02
991	605008	长鸿高科	1,500	21,390.00	0.02
992	301180	万祥科技	1,200	21,036.00	0.02
993	603057	紫燕食品	800	20,104.00	0.02
994	605365	立达信	1,300	19,474.00	0.02
995	603170	宝立食品	900	19,134.00	0.02
996	601279	英利汽车	3,200	17,728.00	0.01
997	601022	宁波远洋	1,700	17,663.00	0.01
998	688046	药康生物	880	17,063.20	0.01
999	301316	慧博云通	600	13,710.00	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301291	明阳电气	2,211	71,730.06	0.06
2	688307	中润光学	1,788	56,733.24	0.05
3	301486	致尚科技	920	53,047.20	0.04
4	301292	海科新源	2,523	50,434.77	0.04
5	301488	豪恩汽电	1,234	49,088.52	0.04
6	688603	天承科技	660	36,300.00	0.03
7	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.03
8	301261	恒工精密	902	33,283.80	0.03
9	301202	朗威股份	1,197	30,906.54	0.03
10	688249	晶合集成	975	17,608.50	0.01
11	688472	阿特斯	675	11,502.00	0.01
12	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.01
13	301293	三博脑科	150	10,713.00	0.01
14	301320	豪江智能	501	10,330.62	0.01
15	688443	智翔金泰	347	10,233.03	0.01
16	688469	中芯集成	1,836	9,932.76	0.01
17	301325	曼恩斯特	91	9,823.45	0.01
18	301317	鑫磊股份	374	9,787.58	0.01
19	688361	中科飞测	150	9,700.50	0.01
20	301419	阿莱德	187	8,199.95	0.01
21	301358	湖南裕能	191	8,191.99	0.01
22	688629	华丰科技	437	8,123.83	0.01
23	301315	威士顿	139	7,105.68	0.01
24	688562	航天软件	317	7,072.27	0.01
25	301399	英特科技	137	7,065.09	0.01
26	688429	时创能源	257	6,766.41	0.01
27	688582	芯动联科	164	6,671.52	0.01
28	301225	恒勃股份	195	6,485.70	0.01

29	301382	蜂助手	190	6,239.60	0.01
30	688543	国科军工	116	6,153.80	0.01
31	301408	华人健康	359	6,085.05	0.00
32	688458	美芯晟	67	6,080.92	0.00
33	301141	中科磁业	141	6,019.29	0.00
34	688593	新相微	408	5,952.72	0.00
35	301295	美硕科技	164	5,915.48	0.00
36	688334	西高院	358	5,803.18	0.00
37	301262	海看股份	226	5,763.00	0.00
38	688484	南芯科技	156	5,726.76	0.00
39	688523	航天环宇	238	5,676.30	0.00
40	301360	荣旗科技	61	5,648.60	0.00
41	688620	安凯微	456	5,627.04	0.00
42	301429	森泰股份	266	5,591.32	0.00
43	688352	颀中科技	453	5,467.71	0.00
44	688552	航天南湖	219	5,146.50	0.00
45	688512	慧智微	267	5,115.72	0.00
46	301232	飞沃科技	87	5,082.54	0.00
47	301305	朗坤环境	255	5,020.95	0.00
48	688535	华海诚科	97	4,969.31	0.00
49	301355	南王科技	295	4,941.25	0.00
50	301332	德尔玛	351	4,819.23	0.00
51	688581	安杰思	39	4,603.17	0.00
52	688433	华曙高科	146	4,599.00	0.00
53	301397	溯联股份	114	4,582.80	0.00
54	301357	北方长龙	92	4,451.88	0.00
55	301428	世纪恒通	143	4,375.80	0.00
56	301170	锡南科技	125	4,366.25	0.00
57	300804	广康生化	132	4,352.04	0.00
58	301376	致欧科技	193	4,344.43	0.00
59	001287	中电港	205	4,309.10	0.00
60	301323	新莱福	109	4,290.24	0.00
61	301281	科源制药	169	4,241.90	0.00
62	688623	双元科技	48	4,165.92	0.00
63	301373	凌玮科技	128	4,076.80	0.00
64	301386	未来电器	165	3,925.35	0.00
65	688631	莱斯信息	130	3,883.10	0.00
66	301157	华塑科技	72	3,810.96	0.00
67	301337	亚华电子	119	3,614.03	0.00
68	601061	中信金属	473	3,585.34	0.00
69	301439	泓淋电力	200	3,380.00	0.00
70	688479	友车科技	108	3,184.92	0.00
71	301345	涛涛车业	67	3,124.88	0.00

72	001380	华纬科技	96	2,954.88	0.00
73	603135	中重科技	159	2,844.51	0.00
74	001282	三联锻造	62	2,047.86	0.00
75	603137	恒尚节能	116	1,982.44	0.00
76	601133	柏诚股份	148	1,814.48	0.00
77	601065	江盐集团	146	1,728.64	0.00
78	603172	万丰股份	107	1,725.91	0.00
79	001328	登康口腔	62	1,580.38	0.00
80	001324	长青科技	77	1,509.20	0.00
81	603125	常青科技	51	1,251.03	0.00
82	001367	海森药业	30	1,184.40	0.00
83	001360	南矿集团	78	1,159.86	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603345	安井食品	794,447.00	0.51
2	300002	神州泰岳	643,512.00	0.41
3	002405	四维图新	405,152.00	0.26
4	001286	陕西能源	361,603.20	0.23
5	002436	兴森科技	338,862.00	0.22
6	688235	百济神州	332,798.11	0.21
7	300502	新易盛	329,844.00	0.21
8	002176	江特电机	329,304.00	0.21
9	002212	天融信	316,768.00	0.20
10	002240	盛新锂能	300,144.00	0.19
11	002219	新里程	296,659.00	0.19
12	000933	神火股份	283,650.00	0.18
13	002044	美年健康	282,049.00	0.18
14	002558	巨人网络	274,732.00	0.17
15	002517	恺英网络	271,141.00	0.17
16	600201	生物股份	260,866.00	0.17
17	000686	东北证券	260,586.00	0.17
18	002463	沪电股份	255,286.00	0.16
19	000423	东阿阿胶	253,383.00	0.16
20	688088	虹软科技	249,089.15	0.16

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	945,237.24	0.60
2	002240	盛新锂能	836,430.00	0.53
3	000423	东阿阿胶	832,953.00	0.53
4	000933	神火股份	825,281.00	0.53
5	300395	菲利华	700,576.00	0.45
6	300502	新易盛	666,516.00	0.42
7	300118	东方日升	645,297.00	0.41
8	002432	九安医疗	636,648.00	0.41
9	300487	蓝晓科技	636,229.50	0.41
10	002405	四维图新	625,393.51	0.40
11	300438	鹏辉能源	553,011.00	0.35
12	001286	陕西能源	545,790.00	0.35
13	002176	江特电机	492,592.32	0.31
14	002558	巨人网络	492,274.00	0.31
15	002517	恺英网络	475,421.00	0.30
16	002436	兴森科技	419,036.00	0.27
17	000893	亚钾国际	404,763.00	0.26
18	002472	双环传动	403,068.00	0.26
19	300459	汤姆猫	397,322.00	0.25
20	300567	精测电子	395,034.00	0.25

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	73,324,345.75
卖出股票收入（成交）总额	98,263,182.64

注：不考虑相关交易费用。

7.5 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）	39,403.28	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	39,403.28	0.03
----	----	-----------	------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	127086	恒邦转债	394	39,403.28	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	134,180.27
2	应收清算款	-
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	209,796.51

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688307	中润光学	56,733.24	0.05	新股锁定期内
2	301486	致尚科技	53,047.20	0.04	新股未上市
3	301292	海科新源	50,434.77	0.04	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	44,155.80	0.04	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	4,932.72	0.00	新股锁定期内
5	301291	明阳电气	6,888.66	0.01	新股锁定期内

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,827	62,453.30	70,492,482.00	61.78	43,609,700.00	38.22

8.2 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	18.40
2	中信证券股份有限公司	13,023,988.00	11.41
3	广发证券股份有限公司	7,318,800.00	6.41

	司		
4	中国国际金融股份有限公司	6,625,800.00	5.81
5	上海或然投资管理有限公司—或然赋益私募证券投资基金	5,537,200.00	4.85
6	张岳旋	4,100,600.00	3.59
7	华泰证券股份有限公司	4,036,800.00	3.54
8	方正证券股份有限公司	4,028,194.00	3.53
9	上海惠澄资产管理有限公司—惠澄仲春五号私募证券投资基金	2,500,000.00	2.19
10	张郭堃	2,174,600.00	1.91

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	156,602,182.00
本报告期基金总申购份额	75,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	117,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	114,102,182.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023 年 4 月 18 日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	6	166,646,601.32	100.00	153,781.38	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	326,109.66	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华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	2023年6月21日
2	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	2023年6月3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	2023年5月16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	2023年5月11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	2023年5月9日
6	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	2023年4月29日
7	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	2023年4月19日
8	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	2023年4月11日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
9	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公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 8 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 30 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	2023 年 3 月 29 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	2023 年 3 月 22 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	2023 年 3 月 21 日
14	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公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 25 日
15	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	2023 年 2 月 23 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 31 日