

# 华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64

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.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.3 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.....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	72
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</b>
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 .....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数证券投资基金
基金简称	华宝中证 1000 指数
场内简称	1000 指数
基金主代码	162413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 19 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,040,893.36 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 6 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102

电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050、 021-38924558	021-60637111
传真	021-38505777	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世 纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世 纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-290,842.93
本期利润	2,775,696.86
加权平均基金份额本期利润	0.0722
本期加权平均净值利润率	7.44%
本期基金份额净值增长率	7.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-64,636,637.81
期末可供分配基金份额利润	-1.6991
期末基金资产净值	40,355,866.63
期末基金份额净值	1.0609
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.54%

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

低于所列数字。

- 2、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）
- 3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.18%	0.96%	3.76%	0.97%	0.42%	-0.01%
过去三个月	13.08%	0.83%	11.91%	0.84%	1.17%	-0.01%
过去六个月	7.17%	1.08%	6.29%	1.10%	0.88%	-0.02%
过去一年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去三年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
自基金合同生效起至今	6.54%	1.06%	5.76%	1.07%	0.78%	-0.01%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率\*95%+同期银行活期存款利率(税后)\*5%。

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

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

华宝中证1000指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例；  
2、本基金是于 2020 年 11 月 19 日由华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型而来。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司与美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.），持有股权占比分别为 51%和 49%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2021 年 6 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行



业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF) 等共 108 只基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丰晨成	本基金基金经理	2020 年 11 月 19 日	-	11 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。2018 年 8 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，疫情对国内的负面影响正逐渐远去，随着疫苗接种速度加快，疫情在国内仅有零星的反复，企业生产和居民生活已基本恢复常态，经济恢复取得明显成效，经济运行开局良好，房地产投资与进出口贸易端延续了 2020 年的表现，对上半年的经济修复贡献力度较大。同时 PPI 上行压力亦比较大，但 CPI 弱势仍比较明显。海外以美国为代表的发达经济体仍在实施大规模刺激政策，因经济重启的预期，全球风险资产表现火爆。作为 A 股市场小盘股的典型代表，中证 1000 指数年初延续了去年下半年以来的疲弱态势，因为市场风格偏向大盘白马股，使得小盘股指数重心处于下移，一直到以创业板为代表的中小市值风格在春节后显著调整后的反弹开始，中

证 1000 开始跟随着中小盘风格明显反弹。本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 7.17%，业绩比较基准收益率为 6.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前疫情仍是外围环境最主要的扰动因素，但随着疫苗的普及，在全球经济修复方向比较明确的情况下，2020 年因疫情所砸出的大坑已处于明显修复中，市场对经济前景的预期趋于乐观，美联储货币政策回归正常化也只是时间早晚的问题。当前我国经济恢复不均衡，由于去年上半年的低基数，因此市场比较一致地预期 2021 年经济增速将呈现前高后低或者是 V 字形的特征。下半年货币政策仍将是“稳”字当头，以适度的货币增长支持经济高质量发展，保持流动性合理充裕，同时还需采取措施保持人民币汇率基本稳定。下半年流动性环境将大概率弱于上半年，但当前市场整体估值尚属合理，企业盈利仍处于增长期，加上居民资产配置权益市场的趋势较为明确，中长期来看依旧对市场有较强支撑。A 股市场或将面临经济增速逐季下降、PPI 高企、外需拉动力度下降、内需复苏情况尚待观察的环境，三季度市场还面临很多不确定风险，我们认为如果从抱团的成长行业中出现撤离，去年全年平淡的小盘股指数可能会获得市场部分资金的青睐，中证 1000 指数表征的小盘股在经历了 15 年以来小盘股的估值逐渐回归正常并向着大中市值估值水平逐渐收敛，半年末中证 1000 指数的 PE (TTM) 估值 36 倍左右，历史上看属于偏低水平。我们认为 2021 年下半年小盘股可能存在阶段性机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

##### (1) 日常估值流程

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

托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

#### (2) 特殊业务估值流程

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金基金资产净值已连续超过六十个工作日低于 5000 万元。根据相关规定，基金管理人已拟定解决方案并报送证监会，基金管理人将尽快付诸实施，并及时履行信息披露义务。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,787,182.82	2,464,173.25
结算备付金		2,297.52	-
存出保证金		1,978.93	3,665.20
交易性金融资产	6.4.7.2	38,054,194.87	36,383,719.57
其中：股票投资		38,054,194.87	36,383,719.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	197,770.00
应收利息	6.4.7.5	266.72	265.12
应收股利		-	-
应收申购款		47,086.53	9,974.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		40,893,007.39	39,059,567.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		217,710.33	-
应付赎回款		193,257.40	426,114.79
应付管理人报酬		16,161.21	10,000.89
应付托管费		3,232.23	1,726.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,579.28	24,356.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,200.31	161,362.52
负债合计		537,140.76	623,561.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	90,912,570.19	92,794,990.81
未分配利润	6.4.7.10	-50,556,703.56	-54,358,984.67
所有者权益合计		40,355,866.63	38,436,006.14
负债和所有者权益总计		40,893,007.39	39,059,567.36

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0609 元，基金份额总额 38,040,893.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		3,050,444.74
1. 利息收入		4,506.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,506.35
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,966.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-270,899.67
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	243,933.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,066,539.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,365.24
减：二、费用		274,747.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	92,309.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,462.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	29,013.68
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	134,962.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,775,696.86
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,775,696.86

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	92,794,990.81	-54,358,984.67	38,436,006.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,775,696.86	2,775,696.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,882,420.62	1,026,584.25	-855,836.37
其中：1. 基金申购款	19,621,509.34	-11,713,864.71	7,907,644.63
2. 基金赎回款	-21,503,929.96	12,740,448.96	-8,763,481.00

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	90,912,570.19	-50,556,703.56	40,355,866.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(原名为华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,638,859.16 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售,按照每份基金份额 1.00 元计算,本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额,其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华宝中证 1000 基础份额”)、华宝



中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华宝中证 1000A 份额”)和华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华宝中证 1000B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额,将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后,华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+4.0%,华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算,计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后,根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日),本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元,基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配;持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份

额的分配。经过上述份额折算后，华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算(基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日)：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 272 号文审核同意，本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金(不

包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2021 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)和在财务报表附注所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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费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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,787,182.82
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,787,182.82

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	35,910,108.19	38,054,194.87	2,144,086.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	35,910,108.19	38,054,194.87	2,144,086.68

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	263.68
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.14
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.90
合计	266.72

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	21,579.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	21,579.28

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	488.13
应付证券出借违约金	-
预提费用	34,712.18
应付指数使用费	50,000.00
合计	85,200.31

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,828,508.58	92,794,990.81
本期申购	8,210,277.61	19,621,509.34
本期赎回（以“-”号填列）	-8,997,892.83	-21,503,929.96
- 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	38,040,893.36	90,912,570.19

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-65,673,713.72	11,314,729.05	-54,358,984.67
本期利润	-290,842.93	3,066,539.79	2,775,696.86
本期基金份额交易产生的变动数	1,327,918.84	-301,334.59	1,026,584.25
其中：基金申购款	-13,890,876.65	2,177,011.94	-11,713,864.71
基金赎回款	15,218,795.49	-2,478,346.53	12,740,448.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-64,636,637.81	14,079,934.25	-50,556,703.56

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	4,379.03
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	94.88
其他	32.44
合计	4,506.35

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-270,899.67
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-270,899.67

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,090,115.53
减：卖出股票成本总额	10,361,015.20
买卖股票差价收入	-270,899.67

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。



## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	243,933.03
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	243,933.03

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,066,539.79
股票投资	3,066,539.79
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,066,539.79

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,365.24
合计	6,365.24

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

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	29,013.68
银行间市场交易费用	-
合计	29,013.68

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	250.00
指数使用费	100,000.00
合计	134,962.18

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司、基金销售机构
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	92,309.99
其中：支付销售机构的客户维护费	36,336.78

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,462.03

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,787,182.82	4,379.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	240	7,574.40	7,574.40	-

注：1. 根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司

股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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

2. 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。

3. 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。

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600093	*ST 易见	2021 年 5 月 6 日	重大事项停牌	5.93	2021 年 7 月 7 日	5.63	3,900	46,804.56	23,127.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 1000 指数。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“以实现与跟踪指数相同”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估

测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于本报告期末，本基金无债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《

公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内,基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则,严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易,不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。



#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,787,182.82	-	-	-	2,787,182.82
结算备付金	2,297.52	-	-	-	2,297.52
存出保证金	1,978.93	-	-	-	1,978.93
交易性金融资产	-	-	-	38,054,194.87	38,054,194.87
应收利息	-	-	-	266.72	266.72
应收申购款	30,321.03	-	-	16,765.50	47,086.53
资产总计	2,821,780.30	-	-	38,071,227.09	40,893,007.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	193,257.40	193,257.40
应付管理人报酬	-	-	-	16,161.21	16,161.21
应付托管费	-	-	-	3,232.23	3,232.23
应付证券清算款	-	-	-	217,710.33	217,710.33
应付交易费用	-	-	-	21,579.28	21,579.28
其他负债	-	-	-	85,200.31	85,200.31
负债总计	-	-	-	537,140.76	537,140.76
利率敏感度缺口	2,821,780.30	-	-	37,534,086.33	40,355,866.63
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	2,464,173.25	-	-	-	2,464,173.25
存出保证金	3,665.20	-	-	-	3,665.20
交易性金融资产	-	-	-	36,383,719.57	36,383,719.57
应收利息	-	-	-	265.12	265.12
应收申购款	1.00	-	-	9,973.22	9,974.22
应收证券清算款	-	-	-	197,770.00	197,770.00
资产总计	2,467,839.45	-	-	36,591,727.91	39,059,567.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	426,114.79	426,114.79
应付管理人报酬	-	-	-	10,000.89	10,000.89
应付托管费	-	-	-	1,726.71	1,726.71
应付交易费用	-	-	-	24,356.31	24,356.31
其他负债	-	-	-	161,362.52	161,362.52
负债总计	-	-	-	623,561.22	623,561.22
利率敏感度缺口	2,467,839.45	-	-	35,968,166.69	38,436,006.14

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备

付金、存出保证金、应收申购款等) 或到期日在一年以内的政府债券。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	38,054,194.87	94.30	36,383,719.57	94.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,054,194.87	94.30	36,383,719.57	94.66

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	1,966,213.88	-
	2. 业绩比较基准下降 5%	-1,966,213.88	-

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 38,046,620.47 元，属于第二层次的余额为 7,574.40 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 36,361,795.57 元，第二层次 21,924.00 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	38,054,194.87	93.06
	其中：股票	38,054,194.87	93.06
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,789,480.34	6.82
8	其他各项资产	49,332.18	0.12
9	合计	40,893,007.39	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	265,632.95	0.66
B	采矿业	735,011.00	1.82
C	制造业	26,290,829.27	65.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	713,847.02	1.77
E	建筑业	558,884.47	1.38
F	批发和零售业	1,051,796.40	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	675,289.56	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,068,196.62	10.08
J	金融业	590,241.80	1.46
K	房地产业	740,989.92	1.84
L	租赁和商务服务业	250,561.50	0.62
M	科学研究和技术服务业	886,105.92	2.20
N	水利、环境和公共设施管理业	579,224.40	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,180.00	0.03
Q	卫生和社会工作	294,781.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	189,998.20	0.47
S	综合	67,423.10	0.17
	合计	37,970,993.13	94.09

### 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	23,141.23	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,797.20	0.01
E	建筑业	7,574.40	0.02
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	6,585.60	0.02
J	金融业	19,976.31	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,127.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	83,201.74	0.21

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	10,700	341,116.00	0.85
2	300496	中科创达	2,000	314,120.00	0.78
3	002568	百润股份	2,500	236,975.00	0.59
4	000516	国际医学	11,700	220,077.00	0.55

5	603345	安井食品	800	203,216.00	0.50
6	688005	容百科技	1,600	193,920.00	0.48
7	603026	石大胜华	1,100	178,255.00	0.44
8	300363	博腾股份	2,100	176,652.00	0.44
9	600882	妙可蓝多	2,500	174,500.00	0.43
10	002407	多氟多	4,700	167,038.00	0.41
11	300725	药石科技	976	155,096.16	0.38
12	002920	德赛西威	1,400	154,112.00	0.38
13	002409	雅克科技	1,900	153,900.00	0.38
14	300339	润和软件	3,500	151,760.00	0.38
15	300458	全志科技	1,606	140,781.96	0.35
16	300724	捷佳伟创	1,200	139,212.00	0.34
17	002497	雅化集团	6,100	138,958.00	0.34
18	601058	赛轮轮胎	13,740	137,262.60	0.34
19	300568	星源材质	3,266	135,114.42	0.33
20	000733	振华科技	2,200	134,354.00	0.33
21	002402	和而泰	5,550	133,033.50	0.33
22	603456	九洲药业	2,700	131,166.00	0.33
23	300073	当升科技	2,300	129,237.00	0.32
24	603236	移远通信	728	124,204.08	0.31
25	603613	国联股份	1,221	122,063.37	0.30
26	600499	科达制造	8,300	119,520.00	0.30
27	300751	迈为股份	260	118,222.00	0.29
28	688116	天奈科技	1,000	118,000.00	0.29
29	300327	中颖电子	1,380	117,617.40	0.29
30	603127	昭衍新药	640	117,600.00	0.29
31	603267	鸿远电子	900	115,128.00	0.29
32	300379	东方通	4,000	113,960.00	0.28
33	600559	老白干酒	4,305	113,221.50	0.28
34	603678	火炬电子	1,650	111,375.00	0.28
35	002240	盛新锂能	3,900	111,345.00	0.28
36	300390	天华超净	2,300	110,469.00	0.27
37	002139	拓邦股份	6,125	110,188.75	0.27
38	600771	广誉远	2,700	105,570.00	0.26
39	000423	东阿阿胶	2,900	104,139.00	0.26
40	688202	美迪西	200	103,980.00	0.26
41	002145	中核钛白	8,000	103,600.00	0.26
42	002436	兴森科技	9,400	103,400.00	0.26
43	002245	蔚蓝锂芯	5,200	102,440.00	0.25
44	002747	埃斯顿	2,600	101,530.00	0.25
45	002706	良信股份	4,450	100,303.00	0.25
46	300685	艾德生物	960	99,916.80	0.25

47	300747	锐科激光	875	99,802.50	0.25
48	000818	航锦科技	3,400	98,566.00	0.24
49	600711	盛屯矿业	13,800	98,394.00	0.24
50	300502	新易盛	3,125	97,656.25	0.24
51	300373	扬杰科技	1,600	96,864.00	0.24
52	601567	三星医疗	4,500	95,850.00	0.24
53	002151	北斗星通	2,200	94,754.00	0.23
54	688200	华峰测控	200	94,666.00	0.23
55	002541	鸿路钢构	1,600	93,360.00	0.23
56	300767	震安科技	1,120	93,016.00	0.23
57	603005	晶方科技	1,560	92,398.80	0.23
58	300763	锦浪科技	510	92,106.00	0.23
59	300623	捷捷微电	2,430	91,926.90	0.23
60	600100	同方股份	15,000	91,650.00	0.23
61	688388	嘉元科技	1,000	90,960.00	0.23
62	688016	心脉医疗	200	90,922.00	0.23
63	601678	滨化股份	11,300	89,383.00	0.22
64	688188	柏楚电子	200	87,200.00	0.22
65	002389	航天彩虹	3,900	85,137.00	0.21
66	002626	金达威	1,900	84,930.00	0.21
67	688122	西部超导	1,300	84,331.00	0.21
68	002617	露笑科技	6,199	83,562.52	0.21
69	300118	东方日升	4,300	83,420.00	0.21
70	002430	杭氧股份	2,400	83,016.00	0.21
71	601898	中煤能源	11,600	82,940.00	0.21
72	300604	长川科技	1,200	81,852.00	0.20
73	603185	上机数控	450	80,527.50	0.20
74	600110	诺德股份	6,600	80,388.00	0.20
75	002025	航天电器	1,600	80,272.00	0.20
76	000591	太阳能	12,860	80,117.80	0.20
77	300083	创世纪	7,300	79,935.00	0.20
78	603027	千禾味业	3,024	79,500.96	0.20
79	300672	国科微	700	79,471.00	0.20
80	603588	高能环境	5,410	78,336.80	0.19
81	300054	鼎龙股份	4,240	77,380.00	0.19
82	300346	南大光电	2,000	77,360.00	0.19
83	002756	永兴材料	1,300	77,207.00	0.19
84	300395	菲利华	1,600	77,152.00	0.19
85	600873	梅花生物	13,700	76,720.00	0.19
86	603128	华贸物流	5,440	76,649.60	0.19
87	688006	杭可科技	900	76,500.00	0.19
88	002597	金禾实业	2,200	76,340.00	0.19



89	002585	双星新材	3,790	76,292.70	0.19
90	002326	永太科技	3,796	75,882.04	0.19
91	002675	东诚药业	3,600	75,852.00	0.19
92	000683	远兴能源	16,240	75,840.80	0.19
93	688023	安恒信息	300	75,600.00	0.19
94	300143	盈康生命	2,900	74,704.00	0.19
95	300298	三诺生物	2,380	74,541.60	0.18
96	600297	广汇汽车	25,700	74,016.00	0.18
97	300567	精测电子	1,200	73,680.00	0.18
98	688139	海尔生物	700	73,570.00	0.18
99	002163	海南发展	4,200	72,576.00	0.18
100	000933	神火股份	7,600	71,820.00	0.18
101	300079	数码视讯	9,300	71,610.00	0.18
102	300679	电连技术	2,445	70,464.90	0.17
103	300476	胜宏科技	3,220	70,357.00	0.17
104	688018	乐鑫科技	300	70,026.00	0.17
105	000831	五矿稀土	3,600	69,480.00	0.17
106	000155	川能动力	5,000	69,050.00	0.17
107	300775	三角防务	1,800	68,760.00	0.17
108	002610	爱康科技	28,500	67,830.00	0.17
109	300777	中简科技	1,500	67,770.00	0.17
110	300773	拉卡拉	2,400	67,752.00	0.17
111	600323	瀚蓝环境	3,100	67,549.00	0.17
112	002312	川发龙蟒	7,900	67,466.00	0.17
113	300841	康华生物	250	67,200.00	0.17
114	002851	麦格米特	2,150	67,144.50	0.17
115	300674	宇信科技	3,580	66,910.20	0.17
116	300598	诚迈科技	800	66,856.00	0.17
117	600966	博汇纸业	5,100	66,555.00	0.16
118	601677	明泰铝业	3,400	66,470.00	0.16
119	600641	万业企业	3,640	66,393.60	0.16
120	300393	中来股份	5,327	65,841.72	0.16
121	002967	广电计量	1,500	65,700.00	0.16
122	600596	新安股份	3,700	65,564.00	0.16
123	300613	富瀚微	420	65,469.60	0.16
124	603583	捷昌驱动	1,292	65,401.04	0.16
125	600305	恒顺醋业	3,416	65,313.92	0.16
126	002123	梦网科技	3,600	65,016.00	0.16
127	300348	长亮科技	3,550	64,965.00	0.16
128	600363	联创光电	2,300	64,055.00	0.16
129	002291	星期六	3,400	63,852.00	0.16
130	688266	泽璟制药	900	63,639.00	0.16

131	000034	神州数码	2,900	63,365.00	0.16
132	002614	奥佳华	2,800	63,364.00	0.16
133	300294	博雅生物	1,750	63,262.50	0.16
134	600583	海油工程	14,000	63,000.00	0.16
135	002727	一心堂	1,900	62,909.00	0.16
136	300737	科顺股份	2,000	62,880.00	0.16
137	601375	中原证券	12,900	62,823.00	0.16
138	688366	昊海生科	300	62,790.00	0.16
139	000902	新洋丰	4,000	62,520.00	0.15
140	600459	贵研铂业	2,535	62,361.00	0.15
141	688019	安集科技	200	62,200.00	0.15
142	300226	上海钢联	1,043	62,110.65	0.15
143	002036	联创电子	4,723	62,107.45	0.15
144	600151	航天机电	6,300	61,740.00	0.15
145	603520	司太立	1,000	61,650.00	0.15
146	600197	伊力特	2,000	61,320.00	0.15
147	002810	山东赫达	1,300	61,308.00	0.15
148	002214	大立科技	3,200	61,248.00	0.15
149	002850	科达利	700	61,180.00	0.15
150	300171	东富龙	1,500	60,975.00	0.15
151	300748	金力永磁	1,920	60,729.60	0.15
152	300236	上海新阳	1,250	60,675.00	0.15
153	300451	创业慧康	6,857	60,615.88	0.15
154	600963	岳阳林纸	5,730	60,566.10	0.15
155	600185	格力地产	8,180	60,286.60	0.15
156	002332	仙琚制药	4,800	60,192.00	0.15
157	600456	宝钛股份	1,400	60,060.00	0.15
158	002022	科华生物	3,300	59,103.00	0.15
159	603039	泛微网络	887	59,029.85	0.15
160	300036	超图软件	2,700	59,022.00	0.15
161	600096	云天化	4,200	58,968.00	0.15
162	600812	华北制药	5,500	58,575.00	0.15
163	300638	广和通	1,254	58,561.80	0.15
164	000875	吉电股份	10,200	58,548.00	0.15
165	300326	凯利泰	4,300	58,437.00	0.14
166	002023	海特高新	3,900	58,188.00	0.14
167	300803	指南针	1,500	57,900.00	0.14
168	603308	应流股份	2,800	57,820.00	0.14
169	603068	博通集成	700	57,610.00	0.14
170	601908	京运通	6,000	57,600.00	0.14
171	000035	中国天楹	12,600	57,456.00	0.14
172	300369	绿盟科技	3,600	57,420.00	0.14

173	000403	派林生物	1,833	57,042.96	0.14
174	002833	弘亚数控	1,460	56,575.00	0.14
175	300573	兴齐眼药	400	56,412.00	0.14
176	300726	宏达电子	800	56,392.00	0.14
177	603008	喜临门	1,700	56,117.00	0.14
178	600129	太极集团	2,700	56,079.00	0.14
179	688333	铂力特	300	56,073.00	0.14
180	600252	中恒集团	17,000	55,930.00	0.14
181	600267	海正药业	3,700	55,685.00	0.14
182	601311	骆驼股份	4,800	55,536.00	0.14
183	300456	赛微电子	1,840	55,476.00	0.14
184	000923	河钢资源	2,900	55,303.00	0.14
185	002643	万润股份	3,100	55,118.00	0.14
186	600993	马应龙	1,900	54,872.00	0.14
187	300132	青松股份	2,600	54,860.00	0.14
188	601222	林洋能源	6,608	54,780.32	0.14
189	688007	光峰科技	1,300	54,444.00	0.13
190	600059	古越龙山	4,200	54,432.00	0.13
191	688166	博瑞医药	1,300	54,353.00	0.13
192	600206	有研新材	3,800	54,340.00	0.13
193	002481	双塔食品	4,700	54,332.00	0.13
194	002318	久立特材	4,500	54,090.00	0.13
195	605111	新洁能	300	54,081.00	0.13
196	300068	南都电源	5,100	54,060.00	0.13
197	002261	拓维信息	5,300	53,901.00	0.13
198	601519	大智慧	6,200	53,878.00	0.13
199	600850	电科数字	2,000	53,820.00	0.13
200	002807	江阴银行	13,600	53,584.00	0.13
201	000650	仁和药业	4,900	53,508.00	0.13
202	002091	江苏国泰	5,860	53,326.00	0.13
203	002239	奥特佳	14,400	53,280.00	0.13
204	600223	鲁商发展	3,300	53,262.00	0.13
205	603606	东方电缆	2,600	52,364.00	0.13
206	600577	精达股份	8,200	52,316.00	0.13
207	600688	上海石化	13,900	52,264.00	0.13
208	300188	美亚柏科	3,000	52,200.00	0.13
209	300323	华灿光电	4,700	51,700.00	0.13
210	300639	凯普生物	1,551	51,198.51	0.13
211	300151	昌红科技	1,900	51,186.00	0.13
212	688158	优刻得	1,300	51,025.00	0.13
213	600740	山西焦化	10,036	50,982.88	0.13
214	600621	华鑫股份	3,200	50,816.00	0.13

215	300487	蓝晓科技	600	50,760.00	0.13
216	300119	瑞普生物	1,500	50,730.00	0.13
217	603113	金能科技	2,800	50,568.00	0.13
218	002099	海翔药业	6,200	50,034.00	0.12
219	300663	科蓝软件	1,300	49,933.00	0.12
220	300666	江丰电子	1,000	49,870.00	0.12
221	601666	平煤股份	7,000	49,770.00	0.12
222	603129	春风动力	400	49,632.00	0.12
223	002413	雷科防务	7,400	49,580.00	0.12
224	603733	仙鹤股份	1,300	49,400.00	0.12
225	002531	天顺风能	5,680	49,132.00	0.12
226	300409	道氏技术	2,060	48,986.80	0.12
227	300131	英唐智控	6,400	48,896.00	0.12
228	002126	银轮股份	4,700	48,880.00	0.12
229	002254	泰和新材	2,400	48,648.00	0.12
230	300233	金城医药	1,700	48,450.00	0.12
231	002063	远光软件	6,108	48,314.28	0.12
232	600773	西藏城投	3,400	48,212.00	0.12
233	600338	西藏珠峰	3,400	48,178.00	0.12
234	300457	赢合科技	2,425	48,160.50	0.12
235	000712	锦龙股份	2,800	48,160.00	0.12
236	000059	华锦股份	5,900	48,144.00	0.12
237	002262	恩华药业	3,136	48,137.60	0.12
238	600211	西藏药业	760	47,940.80	0.12
239	300352	北信源	6,875	47,850.00	0.12
240	603919	金徽酒	1,160	47,699.20	0.12
241	300034	钢研高纳	1,479	47,638.59	0.12
242	600587	新华医疗	2,100	47,565.00	0.12
243	603043	广州酒家	1,840	47,324.80	0.12
244	000016	深康佳 A	7,100	47,286.00	0.12
245	603489	八方股份	200	47,276.00	0.12
246	002285	世联行	7,700	47,201.00	0.12
247	000672	上峰水泥	2,700	47,196.00	0.12
248	603187	海容冷链	1,100	47,168.00	0.12
249	300185	通裕重工	15,400	47,124.00	0.12
250	603218	日月股份	1,740	47,119.20	0.12
251	000976	华铁股份	8,000	46,960.00	0.12
252	600246	万通发展	5,200	46,904.00	0.12
253	600330	天通股份	4,780	46,891.80	0.12
254	002484	江海股份	3,016	46,687.68	0.12
255	601918	新集能源	9,500	46,455.00	0.12
256	300102	乾照光电	5,000	46,450.00	0.12

257	603025	大豪科技	1,200	46,104.00	0.11
258	300616	尚品宅配	520	46,025.20	0.11
259	300792	壹网壹创	900	45,927.00	0.11
260	600685	中船防务	2,200	45,760.00	0.11
261	002928	华夏航空	3,025	45,677.50	0.11
262	688198	佰仁医疗	200	45,600.00	0.11
263	000848	承德露露	3,800	45,372.00	0.11
264	000735	罗牛山	5,700	44,973.00	0.11
265	688037	芯源微	300	44,700.00	0.11
266	000627	天茂集团	12,300	44,526.00	0.11
267	002171	楚江新材	5,100	44,523.00	0.11
268	002324	普利特	3,800	44,460.00	0.11
269	600360	华微电子	4,900	44,394.00	0.11
270	002258	利尔化学	1,700	43,860.00	0.11
271	688298	东方生物	200	43,520.00	0.11
272	000555	神州信息	3,000	43,410.00	0.11
273	000917	电广传媒	8,800	43,208.00	0.11
274	603713	密尔克卫	400	43,192.00	0.11
275	002859	洁美科技	1,380	43,152.60	0.11
276	002400	省广集团	8,300	43,077.00	0.11
277	600063	皖维高新	8,400	43,008.00	0.11
278	300101	振芯科技	2,400	42,984.00	0.11
279	300762	上海瀚讯	1,520	42,940.00	0.11
280	603429	集友股份	1,320	42,900.00	0.11
281	300123	亚光科技	3,840	42,854.40	0.11
282	000560	我爱我家	9,580	42,822.60	0.11
283	002100	天康生物	4,800	42,768.00	0.11
284	600562	国睿科技	2,832	42,678.24	0.11
285	300087	荃银高科	1,900	42,579.00	0.11
286	601028	玉龙股份	2,400	42,480.00	0.11
287	300149	睿智医药	2,200	42,438.00	0.11
288	300662	科锐国际	700	42,434.00	0.11
289	600612	老凤祥	800	42,376.00	0.11
290	600320	振华重工	12,500	42,375.00	0.11
291	600682	南京新百	4,200	42,252.00	0.10
292	002428	云南锗业	3,400	42,126.00	0.10
293	603599	广信股份	1,400	42,112.00	0.10
294	000710	贝瑞基因	1,400	42,056.00	0.10
295	300525	博思软件	2,360	41,890.00	0.10
296	600378	昊华科技	1,900	41,857.00	0.10
297	601965	中国汽研	2,400	41,472.00	0.10
298	600635	大众公用	11,600	41,412.00	0.10

299	300377	赢时胜	3,700	41,218.00	0.10
300	600720	祁连山	3,900	41,106.00	0.10
301	600057	厦门象屿	6,526	40,787.50	0.10
302	600797	浙大网新	6,100	40,748.00	0.10
303	002698	博实股份	3,200	40,736.00	0.10
304	000582	北部湾港	4,900	40,670.00	0.10
305	000951	中国重汽	1,500	40,590.00	0.10
306	002106	莱宝高科	3,600	40,500.00	0.10
307	002158	汉钟精机	1,500	40,275.00	0.10
308	002130	沃尔核材	6,300	40,257.00	0.10
309	300438	鹏辉能源	1,750	40,075.00	0.10
310	002803	吉宏股份	1,400	39,732.00	0.10
311	300232	洲明科技	4,448	39,720.64	0.10
312	600984	建设机械	3,700	39,627.00	0.10
313	600496	精工钢构	9,700	39,576.00	0.10
314	000969	安泰科技	4,600	39,560.00	0.10
315	002310	东方园林	11,600	39,556.00	0.10
316	300055	万邦达	4,300	39,474.00	0.10
317	002097	山河智能	4,600	39,468.00	0.10
318	603596	伯特利	1,100	39,325.00	0.10
319	300287	飞利信	7,100	39,121.00	0.10
320	002237	恒邦股份	3,400	39,066.00	0.10
321	000921	海信家电	2,700	38,799.00	0.10
322	002020	京新药业	4,560	38,760.00	0.10
323	002335	科华数据	1,700	38,709.00	0.10
324	000767	晋控电力	11,700	38,610.00	0.10
325	600055	万东医疗	2,300	38,525.00	0.10
326	601001	晋控煤业	5,300	38,478.00	0.10
327	603298	杭叉集团	2,120	38,456.80	0.10
328	300222	科大智能	3,120	38,251.20	0.09
329	002556	辉隆股份	3,500	37,975.00	0.09
330	600864	哈投股份	6,300	37,926.00	0.09
331	000851	高鸿股份	5,700	37,905.00	0.09
332	300783	三只松鼠	800	37,888.00	0.09
333	002079	苏州固锝	3,000	37,800.00	0.09
334	002421	达实智能	9,800	37,632.00	0.09
335	300406	九强生物	1,900	37,487.00	0.09
336	300319	麦捷科技	3,100	37,355.00	0.09
337	603018	华设集团	4,688	37,269.60	0.09
338	600578	京能电力	12,500	37,250.00	0.09
339	002351	漫步者	2,750	37,235.00	0.09
340	300085	银之杰	2,100	37,065.00	0.09

341	603718	海利生物	2,485	37,026.50	0.09
342	000049	德赛电池	805	36,949.50	0.09
343	605376	博迁新材	500	36,940.00	0.09
344	600483	福能股份	3,500	36,715.00	0.09
345	603979	金诚信	2,034	36,612.00	0.09
346	600210	紫江企业	7,700	36,575.00	0.09
347	601212	白银有色	14,000	36,540.00	0.09
348	603690	至纯科技	900	36,369.00	0.09
349	000928	中钢国际	3,820	36,328.20	0.09
350	300158	振东制药	4,700	36,237.00	0.09
351	601952	苏垦农发	3,490	36,226.20	0.09
352	600490	鹏欣资源	9,400	36,190.00	0.09
353	002960	青鸟消防	1,379	36,074.64	0.09
354	600452	涪陵电力	2,500	35,925.00	0.09
355	603686	龙马环卫	2,360	35,895.60	0.09
356	002467	二六三	8,130	35,609.40	0.09
357	002108	沧州明珠	6,442	35,495.42	0.09
358	600761	安徽合力	3,200	35,392.00	0.09
359	603612	索通发展	1,960	35,221.20	0.09
360	600503	华丽家族	9,600	35,040.00	0.09
361	603368	柳药股份	1,770	34,939.80	0.09
362	600662	强生控股	4,000	34,920.00	0.09
363	002611	东方精工	7,540	34,910.20	0.09
364	002222	福晶科技	2,150	34,851.50	0.09
365	002293	罗莱生活	2,600	34,814.00	0.09
366	300470	中密控股	900	34,776.00	0.09
367	002182	云海金属	2,900	34,742.00	0.09
368	002649	博彦科技	3,300	34,650.00	0.09
369	600986	浙文互联	8,240	34,608.00	0.09
370	600742	一汽富维	3,396	34,605.24	0.09
371	600391	航发科技	1,600	34,576.00	0.09
372	002581	未名医药	1,900	34,542.00	0.09
373	600389	江山股份	1,000	34,390.00	0.09
374	001696	宗申动力	4,300	34,314.00	0.09
375	300755	华致酒行	840	34,280.40	0.08
376	601369	陕鼓动力	4,200	34,146.00	0.08
377	603826	坤彩科技	900	34,137.00	0.08
378	300829	金丹科技	520	34,060.00	0.08
379	600295	鄂尔多斯	1,900	33,991.00	0.08
380	300184	力源信息	5,340	33,962.40	0.08
381	000913	钱江摩托	1,900	33,953.00	0.08
382	002832	比音勒芬	1,320	33,778.80	0.08

383	000789	万年青	2,950	33,748.00	0.08
384	688389	普门科技	1,100	33,726.00	0.08
385	688399	硕世生物	200	33,720.00	0.08
386	300219	鸿利智汇	2,550	33,660.00	0.08
387	600751	海航科技	12,100	33,638.00	0.08
388	600073	上海梅林	4,100	33,579.00	0.08
389	002206	海利得	5,400	33,534.00	0.08
390	002043	兔宝宝	3,400	33,524.00	0.08
391	300607	拓斯达	960	33,408.00	0.08
392	002041	登海种业	2,200	33,242.00	0.08
393	002539	云图控股	3,800	33,174.00	0.08
394	603960	克来机电	1,000	33,100.00	0.08
395	300398	飞凯材料	1,820	32,996.60	0.08
396	603323	苏农银行	7,510	32,893.80	0.08
397	300776	帝尔激光	220	32,859.20	0.08
398	002891	中宠股份	800	32,800.00	0.08
399	000603	盛达资源	2,600	32,734.00	0.08
400	000612	焦作万方	4,600	32,614.00	0.08
401	002646	青青稞酒	1,500	32,610.00	0.08
402	300303	聚飞光电	6,340	32,270.60	0.08
403	000657	中钨高新	3,180	32,245.20	0.08
404	002274	华昌化工	3,200	32,224.00	0.08
405	300355	蒙草生态	7,800	32,214.00	0.08
406	600072	中船科技	2,800	32,200.00	0.08
407	000829	天音控股	3,900	32,136.00	0.08
408	300170	汉得信息	4,300	32,121.00	0.08
409	000793	华闻集团	12,100	32,065.00	0.08
410	300177	中海达	3,250	32,045.00	0.08
411	603877	太平鸟	600	32,028.00	0.08
412	300053	欧比特	3,445	32,004.05	0.08
413	300682	朗新科技	1,900	31,958.00	0.08
414	300394	天孚通信	1,260	31,903.20	0.08
415	300702	天宇股份	900	31,878.00	0.08
416	000503	国新健康	4,300	31,863.00	0.08
417	603881	数据港	880	31,856.00	0.08
418	000903	云内动力	8,100	31,752.00	0.08
419	603416	信捷电气	500	31,735.00	0.08
420	002461	珠江啤酒	2,900	31,726.00	0.08
421	603915	国茂股份	800	31,600.00	0.08
422	300633	开立医疗	1,000	31,580.00	0.08
423	000088	盐田港	5,700	31,578.00	0.08
424	300031	宝通科技	2,000	31,520.00	0.08



424	600420	国药现代	3,200	31,520.00	0.08
425	300910	瑞丰新材	300	31,365.00	0.08
426	300497	富祥药业	2,488	31,323.92	0.08
427	300653	正海生物	400	31,320.00	0.08
428	000915	华特达因	1,170	31,274.10	0.08
429	002035	华帝股份	4,330	31,262.60	0.08
430	300078	思创医惠	4,224	31,257.60	0.08
431	603601	再升科技	2,700	31,239.00	0.08
432	002913	奥士康	400	31,180.00	0.08
433	603279	景津环保	1,400	31,024.00	0.08
434	002737	葵花药业	1,900	31,008.00	0.08
435	600326	西藏天路	4,600	31,004.00	0.08
436	600017	日照港	11,600	30,972.00	0.08
437	000828	东莞控股	2,600	30,966.00	0.08
438	603301	振德医疗	700	30,744.00	0.08
439	300397	天和防务	1,580	30,731.00	0.08
440	002449	国星光电	3,030	30,603.00	0.08
441	300006	莱美药业	4,338	30,582.90	0.08
442	600395	盘江股份	4,300	30,530.00	0.08
443	600770	综艺股份	4,900	30,527.00	0.08
444	600789	鲁抗医药	4,140	30,470.40	0.08
445	002216	三全食品	1,850	30,469.50	0.08
446	000550	江铃汽车	1,300	30,459.00	0.08
447	300596	利安隆	700	30,331.00	0.08
448	603989	艾华集团	930	30,308.70	0.08
449	603387	基蛋生物	1,344	30,213.12	0.07
450	300770	新媒股份	620	30,194.00	0.07
451	600123	兰花科创	3,900	30,186.00	0.07
452	000901	航天科技	3,493	30,144.59	0.07
453	600116	三峡水利	3,600	30,096.00	0.07
453	600512	腾达建设	9,900	30,096.00	0.07
454	000592	平潭发展	9,800	30,086.00	0.07
455	600422	昆药集团	3,100	30,070.00	0.07
456	002276	万马股份	4,500	30,015.00	0.07
456	300401	花园生物	2,300	30,015.00	0.07
457	600997	开滦股份	4,000	30,000.00	0.07
458	002677	浙江美大	1,640	29,979.20	0.07
459	002425	凯撒文化	3,580	29,964.60	0.07
460	002847	盐津铺子	300	29,916.00	0.07
461	603801	志邦家居	936	29,914.56	0.07
462	000036	华联控股	6,410	29,870.60	0.07
463	300429	强力新材	2,203	29,850.65	0.07

464	002135	东南网架	3,900	29,835.00	0.07
465	002498	汉缆股份	8,300	29,714.00	0.07
466	002488	金固股份	4,850	29,633.50	0.07
467	603179	新泉股份	900	29,592.00	0.07
468	000006	深振业 A	5,900	29,559.00	0.07
469	600366	宁波韵升	4,400	29,480.00	0.07
470	600337	美克家居	7,000	29,470.00	0.07
471	600750	江中药业	2,220	29,415.00	0.07
472	000958	东方能源	6,700	29,413.00	0.07
473	600285	羚锐制药	2,800	29,400.00	0.07
474	300007	汉威科技	1,600	29,376.00	0.07
475	601827	三峰环境	3,100	29,357.00	0.07
476	300477	合纵科技	4,260	29,351.40	0.07
477	600502	安徽建工	7,556	29,317.28	0.07
478	300740	水羊股份	1,400	29,232.00	0.07
479	600557	康缘药业	2,600	29,224.00	0.07
480	002636	金安国纪	1,800	29,196.00	0.07
481	601011	宝泰隆	7,100	29,181.00	0.07
482	600477	杭萧钢构	8,170	29,166.90	0.07
483	603313	梦百合	970	29,148.50	0.07
484	000676	智度股份	4,800	29,136.00	0.07
485	300696	爱乐达	700	29,134.00	0.07
486	000070	特发信息	3,580	29,069.60	0.07
487	600491	龙元建设	5,400	29,052.00	0.07
488	600581	八一钢铁	4,700	29,046.00	0.07
489	601163	三角轮胎	2,000	29,040.00	0.07
490	000927	中国铁物	7,800	29,016.00	0.07
491	600277	亿利洁能	8,600	28,982.00	0.07
492	603393	新天然气	1,584	28,955.52	0.07
493	300735	光弘科技	2,366	28,770.56	0.07
494	300145	中金环境	9,440	28,697.60	0.07
495	002912	中新赛克	700	28,679.00	0.07
496	000566	海南海药	4,900	28,665.00	0.07
497	300307	慈星股份	3,500	28,630.00	0.07
498	300206	理邦仪器	1,800	28,620.00	0.07
499	688033	天宜上佳	1,800	28,602.00	0.07
500	002190	成飞集成	1,100	28,589.00	0.07
501	300579	数字认证	600	28,482.00	0.07
502	002906	华阳集团	900	28,422.00	0.07
503	002218	拓日新能	4,700	28,341.00	0.07
504	600810	神马股份	2,360	28,249.20	0.07
505	603208	江山欧派	300	28,197.00	0.07

506	603060	国检集团	1,652	28,183.12	0.07
507	600125	铁龙物流	5,700	28,101.00	0.07
508	002446	盛路通信	4,320	28,080.00	0.07
509	000030	富奥股份	4,400	28,028.00	0.07
510	002544	杰赛科技	2,100	28,014.00	0.07
511	603876	鼎胜新材	900	27,945.00	0.07
512	300602	飞荣达	1,569	27,928.20	0.07
513	300815	玉禾田	800	27,864.00	0.07
514	600604	市北高新	4,800	27,840.00	0.07
515	000811	冰轮环境	2,650	27,825.00	0.07
516	300224	正海磁材	2,550	27,718.50	0.07
517	002283	天润工业	5,000	27,700.00	0.07
517	300791	仙乐健康	500	27,700.00	0.07
518	002726	龙大肉食	2,724	27,566.88	0.07
519	002647	仁东控股	2,500	27,550.00	0.07
520	300194	福安药业	6,000	27,540.00	0.07
521	601137	博威合金	2,400	27,528.00	0.07
522	603378	DR 亚士创	500	27,510.00	0.07
523	300263	隆华科技	4,000	27,480.00	0.07
524	600531	豫光金铅	5,200	27,456.00	0.07
525	600108	亚盛集团	9,700	27,451.00	0.07
526	002567	唐人神	4,150	27,431.50	0.07
527	603566	普莱柯	1,200	27,360.00	0.07
528	300020	银江股份	3,200	27,328.00	0.07
529	002918	蒙娜丽莎	870	27,309.30	0.07
530	600169	太原重工	11,100	27,306.00	0.07
531	300821	东岳硅材	2,100	27,300.00	0.07
532	300075	数字政通	2,300	27,071.00	0.07
533	600308	华泰股份	4,900	27,048.00	0.07
534	300768	迪普科技	700	27,041.00	0.07
535	600552	凯盛科技	3,900	26,988.00	0.07
536	603305	旭升股份	800	26,984.00	0.07
537	000543	皖能电力	7,100	26,909.00	0.07
538	300134	大富科技	2,400	26,904.00	0.07
539	300292	吴通控股	6,800	26,860.00	0.07
540	300659	中孚信息	800	26,856.00	0.07
541	002367	康力电梯	3,000	26,820.00	0.07
542	603118	共进股份	2,900	26,767.00	0.07
543	300114	中航电测	1,750	26,600.00	0.07
544	002376	新北洋	2,900	26,506.00	0.07
545	600284	浦东建设	4,000	26,440.00	0.07
546	600846	同济科技	3,100	26,412.00	0.07

547	000801	四川九洲	3,900	26,403.00	0.07
548	002975	博杰股份	300	26,400.00	0.07
549	300238	冠昊生物	1,300	26,377.00	0.07
550	002042	华孚时尚	5,450	26,323.50	0.07
551	300322	硕贝德	2,100	26,313.00	0.07
552	300850	新强联	300	26,307.00	0.07
553	601619	嘉泽新能	6,900	26,289.00	0.07
554	600668	尖峰集团	2,200	26,268.00	0.07
555	600748	上实发展	5,700	26,220.00	0.06
556	002201	九鼎新材	1,680	26,124.00	0.06
557	002301	齐心集团	2,600	26,104.00	0.06
558	000667	美好置业	15,400	26,026.00	0.06
559	002055	得润电子	2,000	25,960.00	0.06
560	601126	四方股份	2,900	25,955.00	0.06
561	300572	安车检测	800	25,952.00	0.06
562	002226	江南化工	5,060	25,907.20	0.06
563	002990	盛视科技	800	25,888.00	0.06
564	000652	泰达股份	6,000	25,860.00	0.06
565	002977	天箭科技	300	25,848.00	0.06
566	000823	超声电子	2,300	25,829.00	0.06
567	300624	万兴科技	440	25,775.20	0.06
568	300709	精研科技	600	25,602.00	0.06
569	600756	浪潮软件	1,900	25,574.00	0.06
570	300441	鲍斯股份	2,460	25,534.80	0.06
571	300045	华力创通	2,600	25,532.00	0.06
572	600103	青山纸业	10,270	25,469.60	0.06
573	002768	国恩股份	1,000	25,380.00	0.06
574	002695	煌上煌	1,600	25,328.00	0.06
575	300861	美畅股份	300	25,293.00	0.06
576	000697	炼石航空	3,000	25,290.00	0.06
577	002015	协鑫能科	2,800	25,284.00	0.06
578	300191	潜能恒信	1,100	25,278.00	0.06
579	600971	恒源煤电	3,800	25,270.00	0.06
580	601929	吉视传媒	13,600	25,160.00	0.06
581	300229	拓尔思	2,800	25,116.00	0.06
582	300256	星星科技	4,850	25,074.50	0.06
583	601890	亚星锚链	4,200	25,074.00	0.06
584	002537	海联金汇	4,580	25,006.80	0.06
585	000910	大亚圣象	2,100	24,948.00	0.06
586	600694	大商股份	1,200	24,912.00	0.06
587	300208	青岛中程	2,450	24,892.00	0.06
588	002697	红旗连锁	4,840	24,877.60	0.06

589	300267	尔康制药	6,500	24,830.00	0.06
590	000507	珠海港	4,100	24,805.00	0.06
591	000881	中广核技	2,400	24,768.00	0.06
591	002573	清新环境	4,800	24,768.00	0.06
592	000032	深桑达 A	1,300	24,739.00	0.06
593	688066	航天宏图	600	24,714.00	0.06
594	600565	迪马股份	9,700	24,638.00	0.06
595	000989	九芝堂	2,505	24,549.00	0.06
596	002639	雪人股份	3,500	24,500.00	0.06
597	603896	寿仙谷	600	24,444.00	0.06
598	300368	汇金股份	2,000	24,420.00	0.06
599	300353	东土科技	2,500	24,300.00	0.06
600	002435	长江健康	4,300	24,295.00	0.06
601	300284	苏文科	4,152	24,289.20	0.06
602	002298	中电兴发	3,400	24,276.00	0.06
603	300523	辰安科技	1,000	24,260.00	0.06
604	002489	浙江永强	6,900	24,219.00	0.06
605	002596	海南瑞泽	5,000	24,150.00	0.06
606	300203	聚光科技	2,000	24,080.00	0.06
607	002320	海峡股份	4,100	24,067.00	0.06
608	002605	姚记科技	1,100	24,057.00	0.06
609	000682	东方电子	5,000	24,050.00	0.06
610	603108	润达医疗	2,140	24,032.20	0.06
611	300766	每日互动	1,600	23,984.00	0.06
612	002292	奥飞娱乐	3,700	23,976.00	0.06
613	603609	禾丰股份	2,300	23,966.00	0.06
614	002479	富春环保	3,700	23,939.00	0.06
615	603587	地素时尚	960	23,913.60	0.06
616	600990	四创电子	600	23,862.00	0.06
617	300266	兴源环境	6,200	23,808.00	0.06
618	000936	华西股份	3,400	23,800.00	0.06
619	601606	长城军工	2,300	23,759.00	0.06
620	600343	航天动力	2,400	23,736.00	0.06
621	300657	弘信电子	1,400	23,730.00	0.06
622	600602	云赛智联	4,000	23,720.00	0.06
623	601588	北辰实业	10,100	23,634.00	0.06
624	002251	步步高	3,200	23,552.00	0.06
625	603688	石英股份	1,000	23,500.00	0.06
626	600710	苏美达	3,800	23,484.00	0.06
627	002378	章源钨业	2,500	23,450.00	0.06
628	002530	金财互联	2,420	23,425.60	0.06
629	000796	凯撒旅业	2,500	23,375.00	0.06

630	002777	久远银海	1,320	23,350.80	0.06
631	000900	现代投资	5,700	23,313.00	0.06
632	300738	奥飞数据	1,120	23,284.80	0.06
633	601886	江河集团	2,700	23,274.00	0.06
634	603766	隆鑫通用	6,400	23,232.00	0.06
635	600133	东湖高新	3,900	23,205.00	0.06
636	300366	创意信息	2,600	23,192.00	0.06
637	300761	立华股份	700	23,191.00	0.06
638	300439	美康生物	1,200	23,160.00	0.06
639	300109	新开源	1,374	23,110.68	0.06
640	300183	东软载波	1,400	22,988.00	0.06
641	002550	千红制药	5,600	22,960.00	0.06
642	300248	新开普	2,323	22,858.32	0.06
643	002061	浙江交科	4,300	22,790.00	0.06
644	002194	武汉凡谷	1,700	22,763.00	0.06
645	600105	永鼎股份	5,940	22,690.80	0.06
646	000931	中关村	3,300	22,671.00	0.06
647	600590	泰豪科技	3,160	22,594.00	0.06
648	002668	奥马电器	4,094	22,557.94	0.06
649	600114	东睦股份	2,680	22,485.20	0.06
650	002309	中利集团	3,600	22,464.00	0.06
651	300386	飞天诚信	1,300	22,399.00	0.06
652	002741	光华科技	1,400	22,358.00	0.06
653	002733	雄韬股份	1,350	22,356.00	0.06
654	600217	中再资环	4,400	22,352.00	0.06
655	600075	新疆天业	3,280	22,304.00	0.06
656	300349	金卡智能	1,900	22,287.00	0.06
657	002516	旷达科技	4,200	22,260.00	0.06
658	603466	风语筑	1,360	22,236.00	0.06
659	002930	宏川智慧	1,358	22,230.46	0.06
660	300047	天源迪科	3,045	22,228.50	0.06
661	300455	康拓红外	2,200	22,154.00	0.05
662	603363	傲农生物	2,150	22,145.00	0.05
663	000950	重药控股	4,400	22,132.00	0.05
664	000810	创维数字	2,600	22,126.00	0.05
665	000600	建投能源	4,500	22,095.00	0.05
666	002383	合众思壮	2,800	22,092.00	0.05
667	300510	金冠股份	3,679	22,074.00	0.05
668	600569	安阳钢铁	7,200	22,032.00	0.05
669	603916	苏博特	1,060	21,878.40	0.05
670	002798	帝欧家居	1,400	21,812.00	0.05
671	600480	凌云股份	2,380	21,800.80	0.05

672	300065	海兰信	1,950	21,781.50	0.05
673	002993	奥海科技	500	21,775.00	0.05
674	605009	豪悦护理	300	21,711.00	0.05
675	600458	时代新材	2,600	21,658.00	0.05
676	601949	中国出版	3,400	21,590.00	0.05
677	300527	中船应急	2,343	21,532.17	0.05
678	002582	好想你	2,300	21,505.00	0.05
678	600261	阳光照明	5,500	21,505.00	0.05
679	300091	金通灵	5,120	21,504.00	0.05
680	300190	维尔利	3,300	21,483.00	0.05
681	000795	英洛华	4,300	21,457.00	0.05
682	002277	友阿股份	6,200	21,452.00	0.05
683	600783	鲁信创投	1,800	21,366.00	0.05
684	300548	博创科技	600	21,354.00	0.05
685	300448	浩云科技	2,600	21,320.00	0.05
686	000601	韶能股份	3,900	21,294.00	0.05
687	002522	浙江众成	3,400	21,284.00	0.05
688	002518	科士达	1,475	21,195.75	0.05
689	002104	恒宝股份	3,576	21,169.92	0.05
690	000973	佛塑科技	4,900	21,168.00	0.05
691	600624	复旦复华	2,830	21,140.10	0.05
692	603728	鸣志电器	1,200	21,108.00	0.05
693	600575	淮河能源	9,700	21,049.00	0.05
694	000597	东北制药	4,200	21,042.00	0.05
695	603348	文灿股份	600	21,000.00	0.05
696	000926	福星股份	4,800	20,976.00	0.05
697	603997	继峰股份	2,550	20,961.00	0.05
698	300080	易成新能	4,000	20,960.00	0.05
699	002243	力合科创	2,200	20,922.00	0.05
700	000882	华联股份	12,000	20,880.00	0.05
701	600933	爱柯迪	1,600	20,864.00	0.05
702	603111	康尼机电	4,200	20,790.00	0.05
703	000546	金圆股份	3,200	20,768.00	0.05
704	300039	上海凯宝	4,000	20,760.00	0.05
705	002034	旺能环境	1,300	20,735.00	0.05
706	300310	宜通世纪	4,488	20,734.56	0.05
707	300664	鹏鹞环保	3,100	20,708.00	0.05
708	603337	杰克股份	772	20,635.56	0.05
709	600831	广电网络	3,500	20,615.00	0.05
710	002651	利君股份	1,700	20,553.00	0.05
711	600449	宁夏建材	1,800	20,448.00	0.05
712	300378	鼎捷软件	950	20,396.50	0.05

713	600715	文投控股	6,700	20,301.00	0.05
714	600736	苏州高新	4,300	20,210.00	0.05
715	002515	金字火腿	4,220	20,129.40	0.05
716	000639	西王食品	3,424	20,098.88	0.05
717	603920	世运电路	1,430	20,062.90	0.05
718	603666	DR 亿嘉和	220	20,055.20	0.05
719	300673	佩蒂股份	900	20,034.00	0.05
719	603229	奥翔药业	600	20,034.00	0.05
720	601366	利群股份	3,200	20,032.00	0.05
721	002609	捷顺科技	2,000	20,020.00	0.05
722	601069	西部黄金	1,600	20,016.00	0.05
723	002641	永高股份	2,900	20,010.00	0.05
724	002115	三维通信	3,500	19,985.00	0.05
725	600855	航天长峰	1,500	19,980.00	0.05
726	300552	万集科技	600	19,968.00	0.05
727	603533	掌阅科技	700	19,950.00	0.05
728	300110	华仁药业	4,520	19,933.20	0.05
729	002959	小熊电器	300	19,932.00	0.05
730	300130	新国都	1,740	19,905.60	0.05
731	002837	英维克	1,100	19,899.00	0.05
732	000557	西部创业	5,600	19,824.00	0.05
733	300255	常山药业	3,000	19,800.00	0.05
734	300388	节能国祯	2,600	19,760.00	0.05
735	002161	远望谷	3,600	19,728.00	0.05
736	002117	东港股份	2,350	19,716.50	0.05
737	300205	天喻信息	1,600	19,696.00	0.05
738	300311	任子行	3,331	19,686.21	0.05
739	000918	嘉凯城	4,500	19,665.00	0.05
740	002746	仙坛股份	2,915	19,617.95	0.05
741	600331	宏达股份	9,600	19,584.00	0.05
742	603012	创力集团	3,200	19,552.00	0.05
743	002166	莱茵生物	2,500	19,500.00	0.05
744	300016	北陆药业	2,150	19,479.00	0.05
745	002672	东江环保	2,600	19,474.00	0.05
746	002017	东信和平	1,700	19,431.00	0.05
747	600975	新五丰	2,900	19,430.00	0.05
748	300520	科大国创	900	19,395.00	0.05
749	300526	中潜股份	580	19,372.00	0.05
750	300066	三川智慧	3,800	19,342.00	0.05
751	603610	麒盛科技	1,075	19,296.25	0.05
752	603636	南威软件	2,000	19,260.00	0.05
753	300198	纳川股份	5,080	19,253.20	0.05



754	002717	岭南股份	6,380	19,203.80	0.05
755	002512	达华智能	5,100	19,176.00	0.05
756	600550	保变电气	4,600	19,136.00	0.05
757	002322	理工环科	1,700	19,125.00	0.05
758	002215	诺普信	3,400	19,108.00	0.05
759	000935	四川双马	1,400	19,096.00	0.05
760	002197	证通电子	2,600	19,084.00	0.05
761	600495	晋西车轴	5,280	19,060.80	0.05
762	002950	奥美医疗	1,150	19,044.00	0.05
763	603936	博敏电子	1,600	18,960.00	0.05
764	002869	金溢科技	800	18,944.00	0.05
765	300785	值得买	199	18,905.00	0.05
766	002822	中装建设	3,100	18,848.00	0.05
767	002664	长鹰信质	1,200	18,732.00	0.05
768	300299	富春股份	3,240	18,694.80	0.05
769	603180	金牌厨柜	392	18,694.48	0.05
770	603328	依顿电子	2,500	18,625.00	0.05
771	688020	方邦股份	200	18,594.00	0.05
772	603730	岱美股份	1,019	18,566.18	0.05
773	002267	陕天然气	2,700	18,549.00	0.05
774	300081	恒信东方	2,400	18,504.00	0.05
775	002565	顺灏股份	4,700	18,471.00	0.05
776	000688	国城矿业	2,100	18,333.00	0.05
777	000040	东旭蓝天	6,500	18,265.00	0.05
778	002984	森麒麟	500	18,225.00	0.05
778	300723	一品红	540	18,225.00	0.05
779	600636	国新文化	1,800	18,216.00	0.05
780	002657	中科金财	1,600	18,176.00	0.05
781	600894	广日股份	2,700	18,144.00	0.04
782	002978	安宁股份	300	18,126.00	0.04
783	603959	百利科技	1,756	18,069.24	0.04
784	688278	特宝生物	500	18,050.00	0.04
785	002545	东方铁塔	2,400	18,048.00	0.04
786	600523	贵航股份	1,260	18,043.20	0.04
787	600318	新力金融	2,300	18,032.00	0.04
788	603258	电魂网络	700	17,913.00	0.04
789	002047	宝鹰股份	5,100	17,901.00	0.04
790	600775	南京熊猫	2,500	17,900.00	0.04
791	300276	三丰智能	4,480	17,785.60	0.04
792	002519	银河电子	4,210	17,724.10	0.04
793	300302	同有科技	1,640	17,695.60	0.04
794	688086	紫晶存储	700	17,682.00	0.04

795	002755	奥赛康	1,300	17,667.00	0.04
796	300571	平治信息	500	17,650.00	0.04
797	002228	合兴包装	4,700	17,625.00	0.04
798	002204	大连重工	4,800	17,616.00	0.04
799	300215	电科院	2,100	17,598.00	0.04
800	300684	中石科技	800	17,560.00	0.04
801	300860	锋尚文化	300	17,484.00	0.04
802	688085	三友医疗	400	17,452.00	0.04
803	003009	中天火箭	300	17,424.00	0.04
804	600184	光电股份	1,600	17,392.00	0.04
805	002970	锐明技术	400	17,364.00	0.04
806	600510	黑牡丹	2,600	17,342.00	0.04
807	002761	浙江建投	2,100	17,325.00	0.04
808	002547	春兴精工	3,900	17,316.00	0.04
809	600592	龙溪股份	1,800	17,172.00	0.04
810	300531	优博讯	1,100	17,160.00	0.04
811	002542	中化岩土	5,650	17,063.00	0.04
812	002961	瑞达期货	800	17,056.00	0.04
813	300634	彩讯股份	800	16,992.00	0.04
814	300318	博晖创新	2,100	16,947.00	0.04
815	002685	华东重机	3,500	16,940.00	0.04
816	002303	美盈森	4,800	16,848.00	0.04
817	300328	宜安科技	2,220	16,827.60	0.04
818	300204	舒泰神	1,300	16,822.00	0.04
819	600622	光大嘉宝	5,520	16,725.60	0.04
820	002662	京威股份	4,800	16,704.00	0.04
821	002314	南山控股	5,000	16,650.00	0.04
822	003012	东鹏控股	1,000	16,640.00	0.04
823	002979	雷赛智能	580	16,628.60	0.04
824	600335	国机汽车	2,800	16,604.00	0.04
825	300485	赛升药业	1,300	16,588.00	0.04
826	002308	威创股份	3,900	16,575.00	0.04
827	002232	启明信息	1,400	16,548.00	0.04
828	002234	民和股份	1,100	16,533.00	0.04
829	600874	创业环保	2,700	16,497.00	0.04
830	300799	左江科技	300	16,440.00	0.04
831	603579	荣泰健康	400	16,432.00	0.04
832	002313	日海智能	1,400	16,394.00	0.04
833	300252	金信诺	2,040	16,299.60	0.04
834	002344	海宁皮城	4,000	16,280.00	0.04
835	601515	东风股份	2,600	16,276.00	0.04
836	000498	山东路桥	2,900	16,240.00	0.04

837	603626	科森科技	1,780	16,198.00	0.04
838	605338	巴比食品	500	16,165.00	0.04
839	002880	卫光生物	420	16,111.20	0.04
840	300590	移为通信	840	16,077.60	0.04
841	688100	威胜信息	600	16,020.00	0.04
842	603359	东珠生态	960	16,012.80	0.04
843	601330	绿色动力	1,800	16,002.00	0.04
844	000011	深物业 A	1,300	15,808.00	0.04
845	600603	广汇物流	3,900	15,756.00	0.04
846	000065	北方国际	1,825	15,749.75	0.04
847	600054	黄山旅游	1,600	15,744.00	0.04
848	300428	立中集团	1,200	15,732.00	0.04
849	002364	中恒电气	1,900	15,694.00	0.04
850	601609	金田铜业	1,800	15,624.00	0.04
851	600676	交运股份	3,800	15,618.00	0.04
852	603887	城地香江	1,560	15,584.40	0.04
853	300365	恒华科技	1,900	15,580.00	0.04
854	002792	通宇通讯	950	15,513.50	0.04
855	300043	星辉娱乐	4,700	15,463.00	0.04
856	000968	蓝焰控股	2,400	15,408.00	0.04
857	002929	润建股份	600	15,372.00	0.04
858	300855	图南股份	400	15,352.00	0.04
859	600981	汇鸿集团	5,100	15,351.00	0.04
860	605168	三人行	100	15,336.00	0.04
861	603105	芯能科技	1,700	15,317.00	0.04
862	600825	新华传媒	3,400	15,300.00	0.04
863	000885	城发环境	1,600	15,296.00	0.04
864	600876	洛阳玻璃	800	15,272.00	0.04
865	603299	苏盐井神	2,000	15,200.00	0.04
866	300867	圣元环保	500	15,155.00	0.04
867	601700	风范股份	3,600	15,120.00	0.04
868	000797	中国武夷	4,841	15,103.92	0.04
869	688268	华特气体	200	15,036.00	0.04
870	300900	广联航空	400	14,952.00	0.04
871	600686	金龙汽车	2,200	14,938.00	0.04
872	603777	来伊份	900	14,931.00	0.04
873	300800	力合科技	750	14,910.00	0.04
874	603565	中谷物流	500	14,905.00	0.04
875	600929	雪天盐业	2,300	14,789.00	0.04
876	603590	康辰药业	400	14,756.00	0.04
877	300788	中信出版	400	14,708.00	0.04
878	603222	济民医疗	900	14,580.00	0.04

879	300872	天阳科技	400	14,520.00	0.04
880	300423	昇辉科技	1,300	14,365.00	0.04
881	000544	中原环保	2,350	14,311.50	0.04
882	300603	立昂技术	1,300	14,300.00	0.04
883	000791	甘肃电投	3,320	14,276.00	0.04
884	000038	深大通	1,280	14,272.00	0.04
885	603808	歌力思	900	14,220.00	0.04
886	603383	顶点软件	500	14,215.00	0.04
887	002838	道恩股份	800	14,192.00	0.04
888	603869	新智认知	1,600	14,176.00	0.04
889	300842	帝科股份	200	14,136.00	0.04
890	000889	中嘉博创	3,440	14,104.00	0.03
891	300771	智莱科技	580	14,082.40	0.03
892	002782	可立克	1,200	14,052.00	0.03
893	601116	三江购物	1,500	13,965.00	0.03
894	002793	罗欣药业	1,400	13,958.00	0.03
895	000567	海德股份	1,300	13,871.00	0.03
896	000019	深粮控股	1,900	13,832.00	0.03
897	600746	江苏索普	900	13,806.00	0.03
898	002562	兄弟科技	3,260	13,692.00	0.03
899	605388	均瑶健康	600	13,656.00	0.03
900	603367	辰欣药业	1,100	13,640.00	0.03
901	688098	申联生物	1,000	13,610.00	0.03
902	300894	火星人	200	13,600.00	0.03
903	002307	北新路桥	3,000	13,560.00	0.03
904	603220	中贝通信	1,100	13,508.00	0.03
905	688030	山石网科	500	13,500.00	0.03
906	002287	奇正藏药	500	13,485.00	0.03
907	600996	贵广网络	2,600	13,442.00	0.03
908	601858	中国科传	1,500	13,365.00	0.03
909	688177	百奥泰	500	13,120.00	0.03
910	600800	渤海化学	3,000	12,990.00	0.03
911	002955	鸿合科技	680	12,981.20	0.03
912	002941	新疆交建	1,200	12,828.00	0.03
913	600618	氯碱化工	1,400	12,810.00	0.03
914	002973	侨银股份	800	12,744.00	0.03
915	605099	共创草坪	300	12,714.00	0.03
916	000561	烽火电子	1,900	12,711.00	0.03
917	300765	新诺威	918	12,659.22	0.03
918	601595	上海电影	1,080	12,592.80	0.03
919	603360	百傲化学	900	12,546.00	0.03
920	002840	华统股份	1,380	12,433.80	0.03

921	002181	粤传媒	2,900	12,412.00	0.03
922	603169	兰石重装	2,800	12,376.00	0.03
923	002852	道道全	850	12,333.50	0.03
924	600738	丽尚国潮	2,000	12,220.00	0.03
925	002621	美吉姆	2,320	12,180.00	0.03
926	603803	瑞斯康达	1,400	12,166.00	0.03
927	002991	甘源食品	200	12,066.00	0.03
928	688108	赛诺医疗	1,100	12,034.00	0.03
929	300209	天泽信息	1,800	12,024.00	0.03
930	000025	特力A	800	11,904.00	0.03
931	603693	江苏新能	900	11,898.00	0.03
932	603551	奥普家居	1,000	11,880.00	0.03
933	000665	湖北广电	2,940	11,818.80	0.03
934	603283	赛腾股份	400	11,768.00	0.03
935	603093	南华期货	800	11,680.00	0.03
936	603976	正川股份	300	11,406.00	0.03
937	688001	华兴源创	300	11,388.00	0.03
938	603595	东尼电子	424	11,206.32	0.03
939	603053	成都燃气	1,100	11,176.00	0.03
940	300857	协创数据	400	11,168.00	0.03
941	601686	友发集团	1,000	11,160.00	0.03
942	300805	电声股份	800	11,016.00	0.03
943	002980	华盛昌	300	10,785.00	0.03
944	002962	五方光电	840	10,735.20	0.03
945	000058	深赛格	1,800	10,692.00	0.03
946	002631	德尔未来	1,700	10,642.00	0.03
947	000517	荣安地产	4,000	10,600.00	0.03
948	603508	思维列控	540	10,589.40	0.03
949	002895	川恒股份	700	10,549.00	0.03
950	300127	银河磁体	600	10,506.00	0.03
951	603815	交建股份	1,200	10,440.00	0.03
952	002987	京北方	320	10,224.00	0.03
953	300856	科思股份	200	10,062.00	0.02
954	300793	佳禾智能	600	9,780.00	0.02
955	002989	中天精装	300	9,696.00	0.02
956	603212	赛伍技术	300	9,687.00	0.02
957	603327	福蓉科技	600	9,054.00	0.02
958	000666	经纬纺机	1,100	8,767.00	0.02
959	002947	恒铭达	320	8,640.00	0.02
960	605199	葫芦娃	300	8,619.00	0.02
961	603103	横店影视	580	8,537.60	0.02
962	002982	湘佳股份	200	8,530.00	0.02

963	300559	佳发教育	950	8,331.50	0.02
964	605222	起帆电缆	400	8,152.00	0.02
965	605008	长鸿高科	400	7,656.00	0.02
966	603956	威派格	400	7,320.00	0.02
967	300846	首都在线	400	7,272.00	0.02
968	003006	百亚股份	300	7,110.00	0.02
969	603711	香飘飘	400	6,808.00	0.02
970	603839	安正时尚	680	6,500.80	0.02
971	002911	佛燃能源	680	6,385.20	0.02
972	002951	金时科技	600	6,288.00	0.02
973	605136	丽人丽妆	200	6,086.00	0.02
974	688222	成都先导	200	5,900.00	0.01
975	002969	嘉美包装	1,200	5,784.00	0.01
976	605007	五洲特纸	300	5,649.00	0.01
977	603992	松霖科技	300	5,508.00	0.01
978	603013	亚普股份	400	5,432.00	0.01
979	002907	华森制药	400	5,372.00	0.01
980	603530	神马电力	300	5,319.00	0.01
981	603687	大胜达	600	4,704.00	0.01
982	603439	贵州三力	300	4,494.00	0.01
983	300798	锦鸡股份	500	4,480.00	0.01
984	603408	建霖家居	300	4,446.00	0.01
985	605118	力鼎光电	300	4,296.00	0.01
986	688365	光云科技	200	3,806.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600093	*ST 易见	3,900	23,127.00	0.06
2	601528	瑞丰银行	1,283	19,976.31	0.05
3	001207	联科科技	426	14,104.86	0.03
4	001208	华菱线缆	1,169	9,036.37	0.02
5	605287	德才股份	240	7,574.40	0.02
6	603171	税友股份	343	6,585.60	0.02
7	605011	杭州热电	315	2,797.20	0.01

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	352,800.00	0.92

2	300496	中科创达	295,289.00	0.77
3	002568	百润股份	197,975.38	0.52
4	603345	安井食品	186,017.00	0.48
5	002920	德赛西威	153,502.00	0.40
6	300390	天华超净	108,600.00	0.28
7	000423	东阿阿胶	103,269.00	0.27
8	688202	美迪西	101,200.00	0.26
9	600100	同方股份	95,850.00	0.25
10	601898	中煤能源	87,812.00	0.23
11	688023	安恒信息	83,824.17	0.22
12	688200	华峰测控	78,586.00	0.20
13	600297	广汇汽车	72,474.00	0.19
14	688266	泽璟制药	67,500.00	0.18
15	600583	海油工程	64,820.00	0.17
16	002810	山东赫达	64,713.00	0.17
17	300725	药石科技	63,460.00	0.17
18	688166	博瑞医药	58,248.07	0.15
19	600151	航天机电	57,267.00	0.15
20	688158	优刻得	57,135.00	0.15

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000799	酒鬼酒	426,489.00	1.11
2	601636	旗滨集团	210,525.00	0.55
3	300677	英科医疗	192,686.00	0.50
4	300037	新宙邦	178,862.00	0.47
5	002180	纳思达	128,851.00	0.34
6	600988	赤峰黄金	123,440.00	0.32
7	300251	光线传媒	112,359.00	0.29
8	002459	晶澳科技	93,485.00	0.24
9	300751	迈为股份	74,792.00	0.19
10	600906	财达证券	71,443.86	0.19
11	600803	新奥股份	70,337.00	0.18
12	600732	爱旭股份	63,368.00	0.16
13	605499	东鹏饮料	58,344.00	0.15
14	002497	雅化集团	53,525.00	0.14
15	002706	良信股份	53,325.00	0.14
16	300741	华宝股份	52,788.00	0.14

17	600601	ST 方科	46,821.00	0.12
18	000733	振华科技	46,584.00	0.12
19	002532	天山铝业	43,338.00	0.11
20	600868	梅雁吉祥	41,111.00	0.11

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,964,950.71
卖出股票收入（成交）总额	10,090,115.53

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。



### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

中证 1000 基金截至 2021 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的妙可蓝多（600882）的发行人上海妙可蓝多食品科技股份有限公司于 2020 年 12 月 09 日公告，因公司存在以下违规行为：（一）公司控股股东的关联方违规占用上市公司资金；（二）违规资金占用导致公司会计处理存在差错；于 2020 年 12 月 09 日收到上海证券交易所公开批评的处罚。

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

### 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,978.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266.72
5	应收申购款	47,086.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,332.18

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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	600093	*ST 易见	23,127.00	0.06	重大事项停牌
2	605287	德才股份	7,574.40	0.02	新股流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,747	10,152.36	1,593,872.00	4.19	36,447,021.36	95.81

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年11月19日) 基金份额总额	41,884,507.09
本报告期期初基金份额总额	38,828,508.58
本报告期基金总申购份额	8,210,277.61
减：本报告期基金总赎回份额	8,997,892.83
本报告期基金拆分变动份额(份额 减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	38,040,893.36

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。
- 2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比	

					例	
招商证券	2	6,502,775.36	34.74%	5,925.99	34.33%	-
国金证券	1	4,525,029.04	24.17%	4,214.09	24.41%	-
东吴证券	1	2,277,652.33	12.17%	2,121.29	12.29%	-
国泰君安	2	1,405,497.42	7.51%	1,296.15	7.51%	-
信达证券	1	850,515.75	4.54%	792.41	4.59%	-
开源证券	1	793,753.00	4.24%	723.35	4.19%	-
安信证券	1	640,724.85	3.42%	596.80	3.46%	-
广发证券	2	453,878.74	2.42%	422.73	2.45%	-
中泰证券	2	389,139.00	2.08%	354.64	2.05%	-
太平洋证 券	2	300,260.72	1.60%	273.63	1.59%	-
中金国际	1	243,050.00	1.30%	226.41	1.31%	-
银河证券	1	186,068.00	0.99%	173.32	1.00%	-
天风证券	2	110,813.51	0.59%	103.23	0.60%	-
海通证券	1	40,764.25	0.22%	37.95	0.22%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

宏信证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本基金本报告期券商交易单元新增：宏信证券、东莞证券、申港证券。

### 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	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站	2021-3-31
2	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2021-4-22
3	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2021-1-22
4	华宝中证 1000 指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
5	华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2021-3-31
6	华宝中证 1000 指数证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2021-3-31
7	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增中信证券华南为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2021-4-9
8	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同部分条款的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2021-3-31
9	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华鑫证券为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2021-5-28
10	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2021-5-14
11	华宝基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售平台并参加招商银行招赢通平台费率优惠活动的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2021-1-9



## § 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》的要求，2021 年 3 月 31 日，基金管理人布关于修订旗下部分基金基金合同的公告，对基金管理人旗下 34 只指数基金基金合同部分条款进行相应更新，具体内容可详见相关公告，请投资者予以关注。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同；  
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书；  
华宝中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日